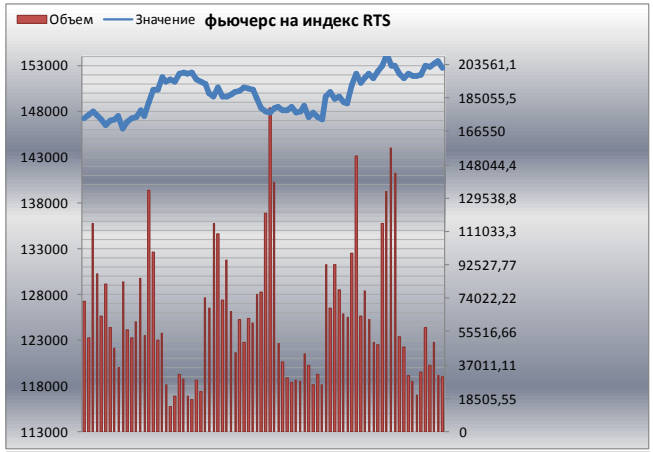
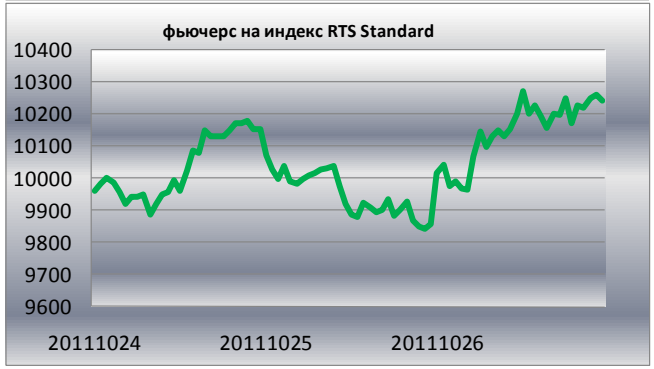
Решения долговых проблем Европы пока не найдено

Лидеры ЕС достигли соглашения с частными кредиторами Греции о 50-процентном сокращении ее долга, а также заявили, что стабфонд будет расширен до 1 трлн евро. По заявлениям Саркози, эти меры позволят снизить уровень госдолга до 120% от ВВП к 2020г. Меж тем, банки — кредиторы Греции заняли жесткую позицию и предупреждают, что списание около 55% долга приведет к дефолту и мощному шоку для финансовых рынков.

Как европейские, так и американские индексы завершили торговую сессию с понижением: FTSE100 +0,50%, DAX –0,51%, CAC40 –0,15% и DowJones +1,39%, S&P500 +1,05%, Nasdaq +0,46%, соответственно.

Фьючерс на нефть марки Brent к концу дня составил $110,27 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1722,55 за тройскую унцию.





	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	152780	1527,80	0,45	915 810	-0,91%	33 812 314 673	18,95%
ROSN-12.11	21695	216,95	0,33	105 058	0,24%	17 736 330	4,23%
LKOH-12.11	17865	1786,50	0,27	146 480	0,26%	73 379 572	3,60%
GAZR-12.11	17943	179,43	0,63	419 650	-0,34%	436 156 356	5,48%
GMKR-12.11	61700	6170,00	-0,22	157 262	0,06%	8 149 717	1,34%
SBRF-12.11	8431	84,31	0,20	985 564	0,40%	831 739 786	8,90%
VTBR-12.11	7155	0,0716	0,34	93 192	0,56%	9 730 369	4,28%
GOLD-12.11	1727	1726,7000	0,35	89 518	-0,87%	617 852 323	11,16%
Si-12.11	30892	30,89	-0,05	1 665 168	0,17%	1 475 831 025	5,58%
Eu-12.11	42909	42,91	0,42	116 786	-0,18%	7 459 741	9,33%
ED-12.11	1,39	1,39	0,49	74 606	15,82%	1 453 038 109	33,82%
SBPR-12.11	6347	63,47	0,57	27 946	0,47%	1 333 817	2,58%
RTSS-12.11	10240	10240,00	0,46	68 156	-0,09%	12 143 340	2,12%
BR-12.11	108	108,14	-0,33	9 282	-0,11%	18 117 844	21,36%

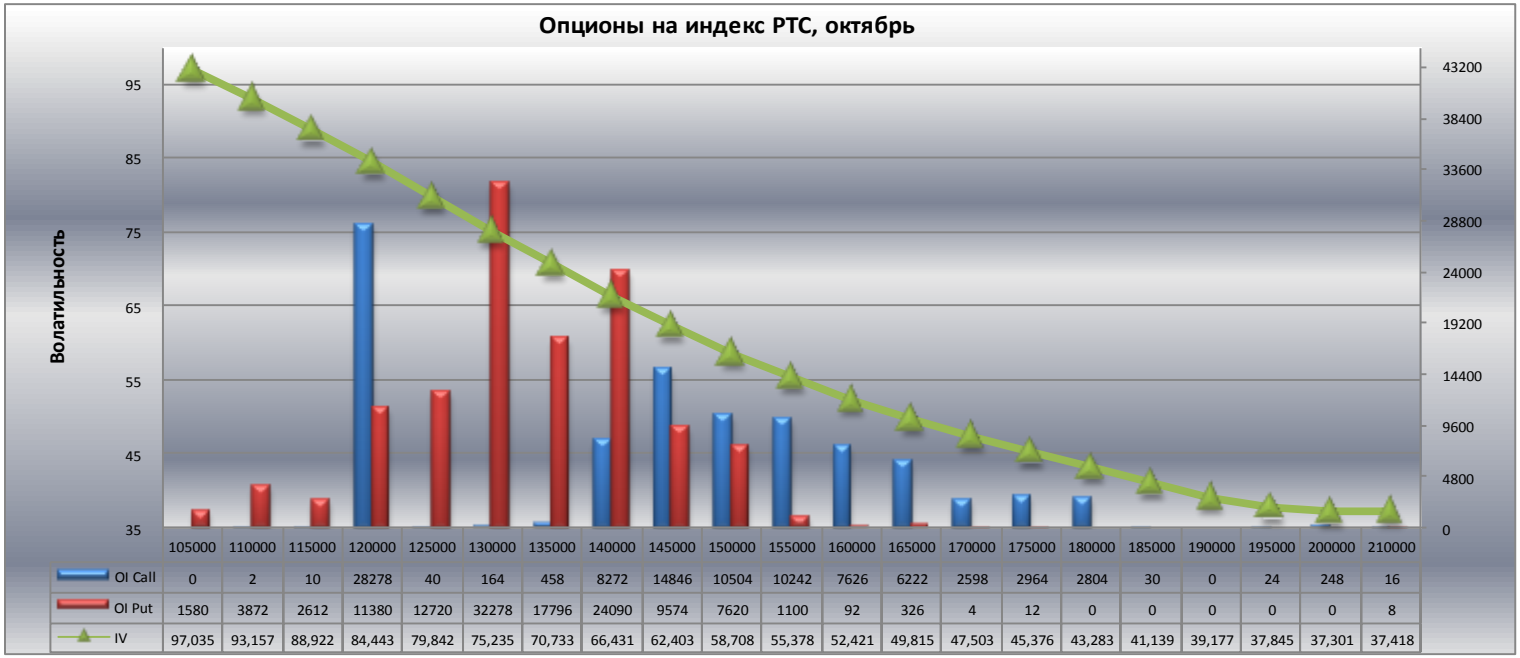
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57143,79	1,52%	00:12:30
CAC 40	3169,62	-0,15%	19:35:18
DAX 30	6016,07	-0,51%	19:35:31
DJ Industrial	11869,04	1,39%	00:42:54
FTSE 100	5553,24	0,50%	19:35:22
Hang Seng	19405,64	1,78%	10:19:17
Nikkei 225	8881,38	1,52%	09:00:03
S&P 500	1242	1,05%	00:02:19
Brent 12.11	110,27419	1,25%	01:09:18
Gold	1722,55	-0,06%	10:19:18
Palladium	648,3	0,35%	10:19:25
Platinum	1598	0,05%	10:18:11
RTSI	1 492,84	-0,48%	23:50:00
RTS_Standard	9 850,29	-0,54%	23:50:00
RTSI_DEREX	1526.86	#ЗНАЧ!	18:45:00

Вечерняя сессия

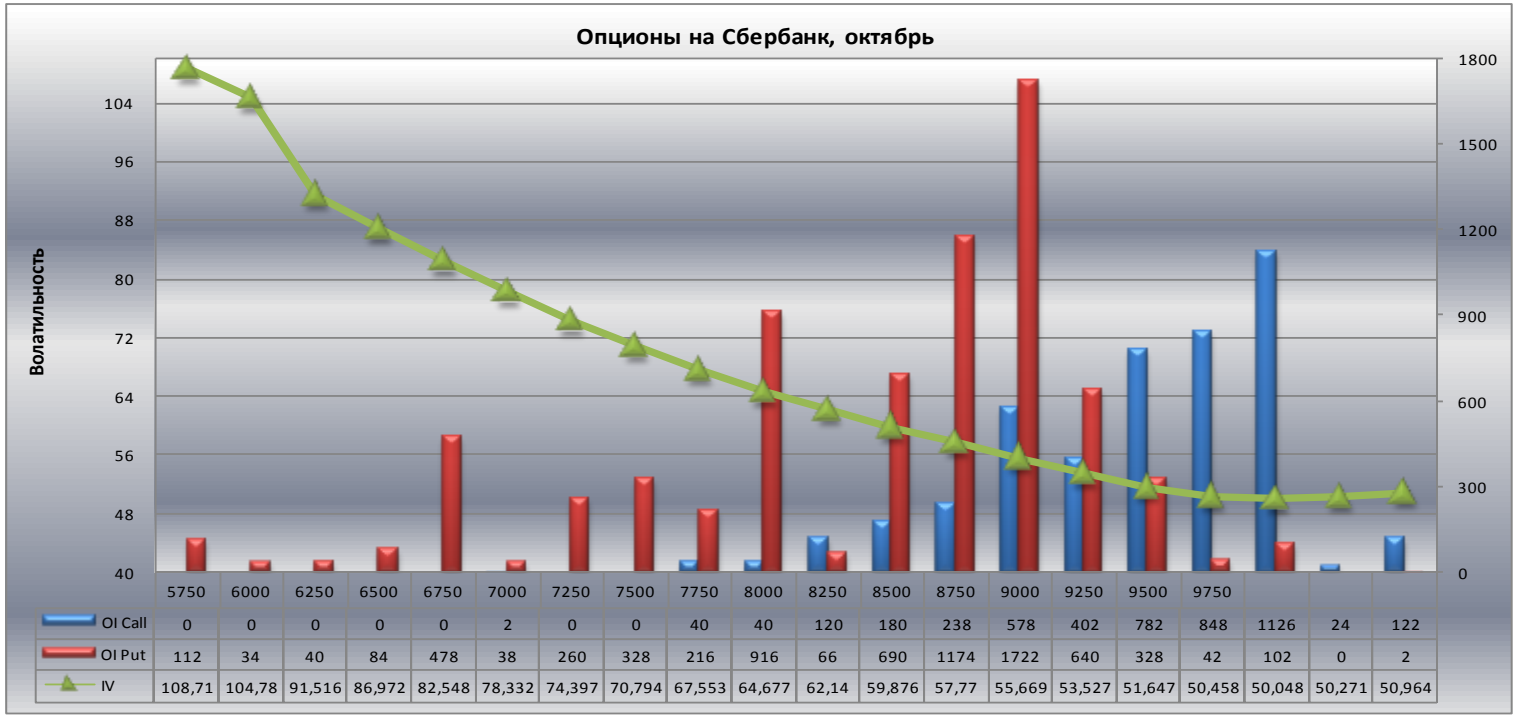
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	0,45	915810	33812314673,18	152780
ROSN-12.11	0,33	105058	17736330,00	21695
LKOH-12.11	0,27	146480	73379572,00	17865
GAZR-12.11	0,63	419650	436156356,00	17943
GMKR-12.11	-0,22	157262	8149717,00	61700
SBRF-12.11	0,2	985564	831739786,00	8431
VTBR-12.11	0,34	93192	9730369,00	7155
GOLD-12.11	0,35	89518	617852322,96	1726,7
Si-12.11	-0,05	1665168	1475831025,00	30892
Eu-12.11	0,42	116786	7459741,00	42909
ED-12.11	0,49	74606	1453038109,02	1,3893
SBPR-12.11	0,57	27946	1333817,00	6347
RTSS-12.11	0,46	68156	12143340,00	10240
BR-12.11	-0,33	9 282	18117843,99	108,14

Дневная сессия

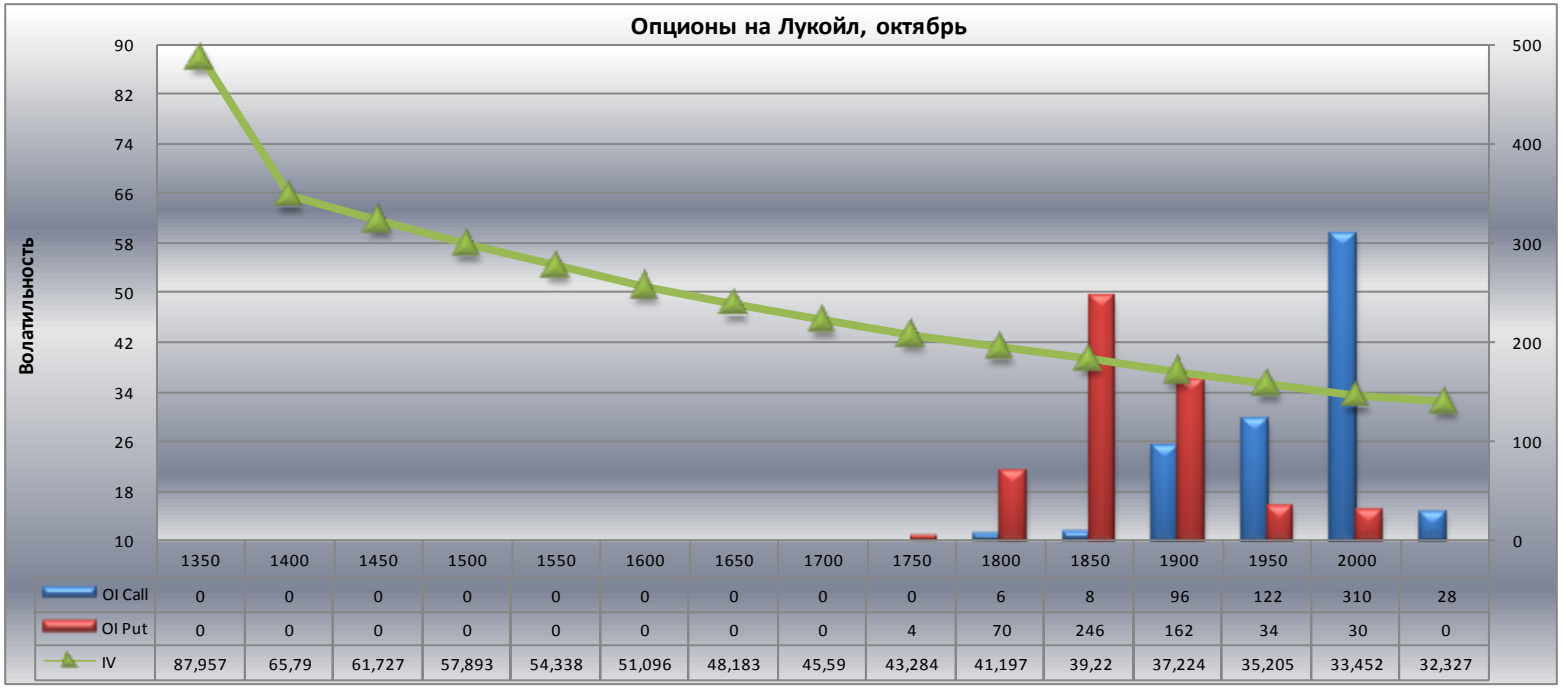
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	2,46	924176	178401517503,14	152095
ROSN-12.11	3,66	104810	418893844,00	21623
LKOH-12.11	0,82	146104	2036175376,00	17817
GAZR-12.11	5,31	421088	7955459658,00	17831
GMKR-12.11	0,21	157174	606134470,00	61838
SBRF-12.11	1,82	981626	9350292570,00	8414
VTBR-12.11	1,62	92670	227185034,00	7131
GOLD-12.11	1,79	90302	5538700916,78	1720,6
Si-12.11	0,49	1662412	26426849191,00	30906
Eu-12.11	-0,17	116994	79923884,00	42730
ED-12.11	-0,67	64414	4296744512,34	1,3825
SBPR-12.11	2,1	27814	51643403,00	6314
RTSS-12.11	2,89	68216	571611435,00	10193
BR-12.11	-0,52	9 292	84804773,45	108,5

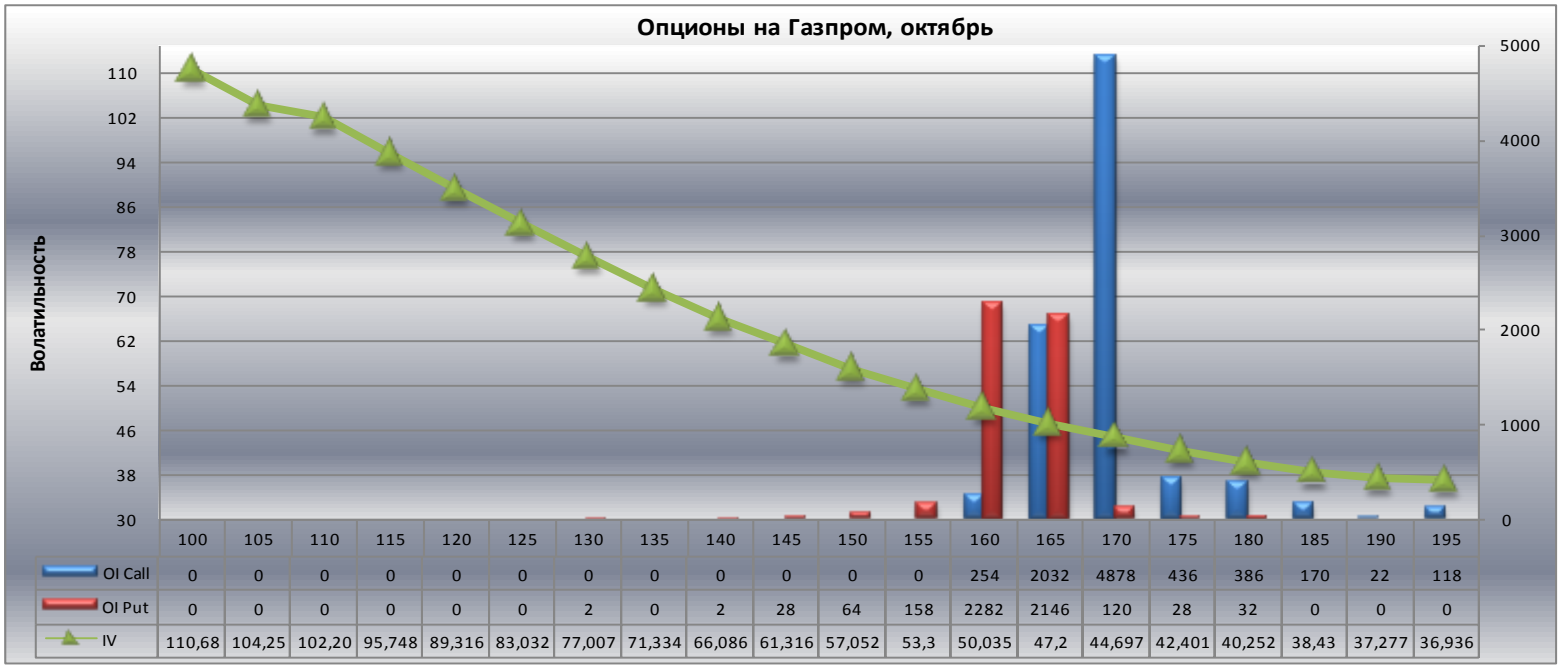


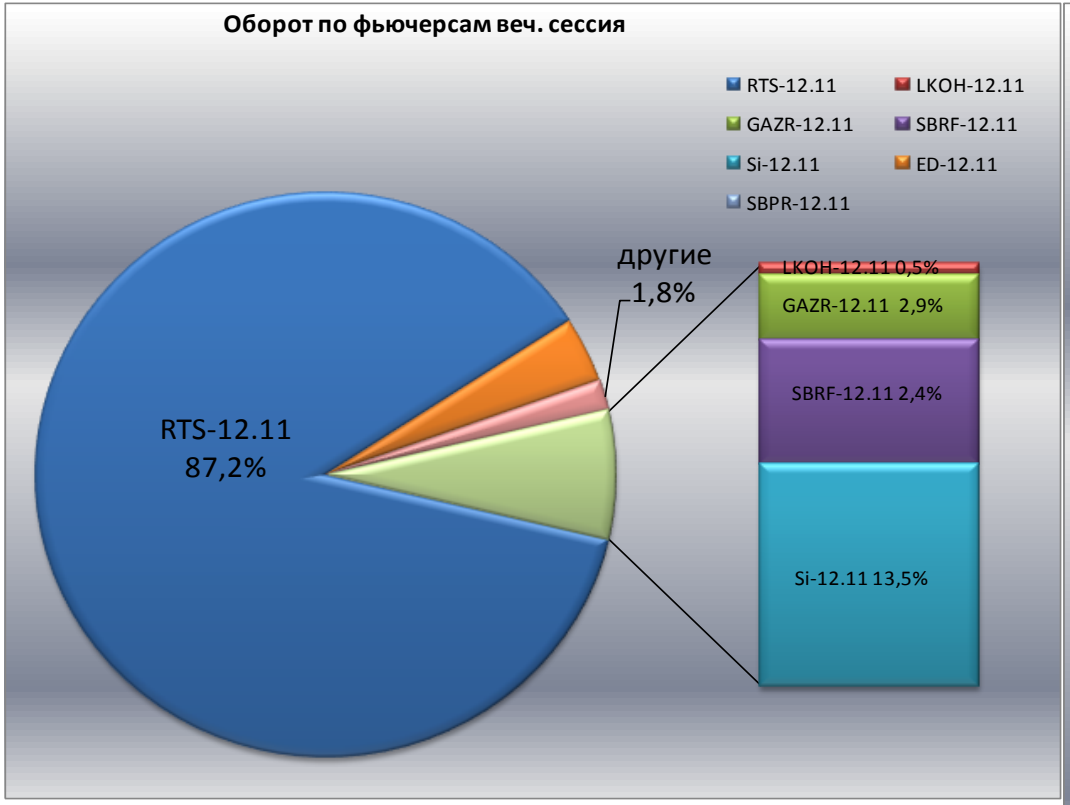
	105000	110000	115000	120000	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	210000
OI Call	0	2	10	28278	40	164	458	8272	14846	10504	10242	7626	6222	2598	2964	2804	30	0	24	248	16
OI Put	1580	3872	2612	11380	12720	32278	17796	24090	9574	7620	1100	92	326	4	12	0	0	0	0	0	8
IV	97,035	93,157	88,922	84,443	79,842	75,235	70,733	66,431	62,403	58,708	55,378	52,421	49,815	47,503	45,376	43,283	41,139	39,177	37,845	37,301	37,418

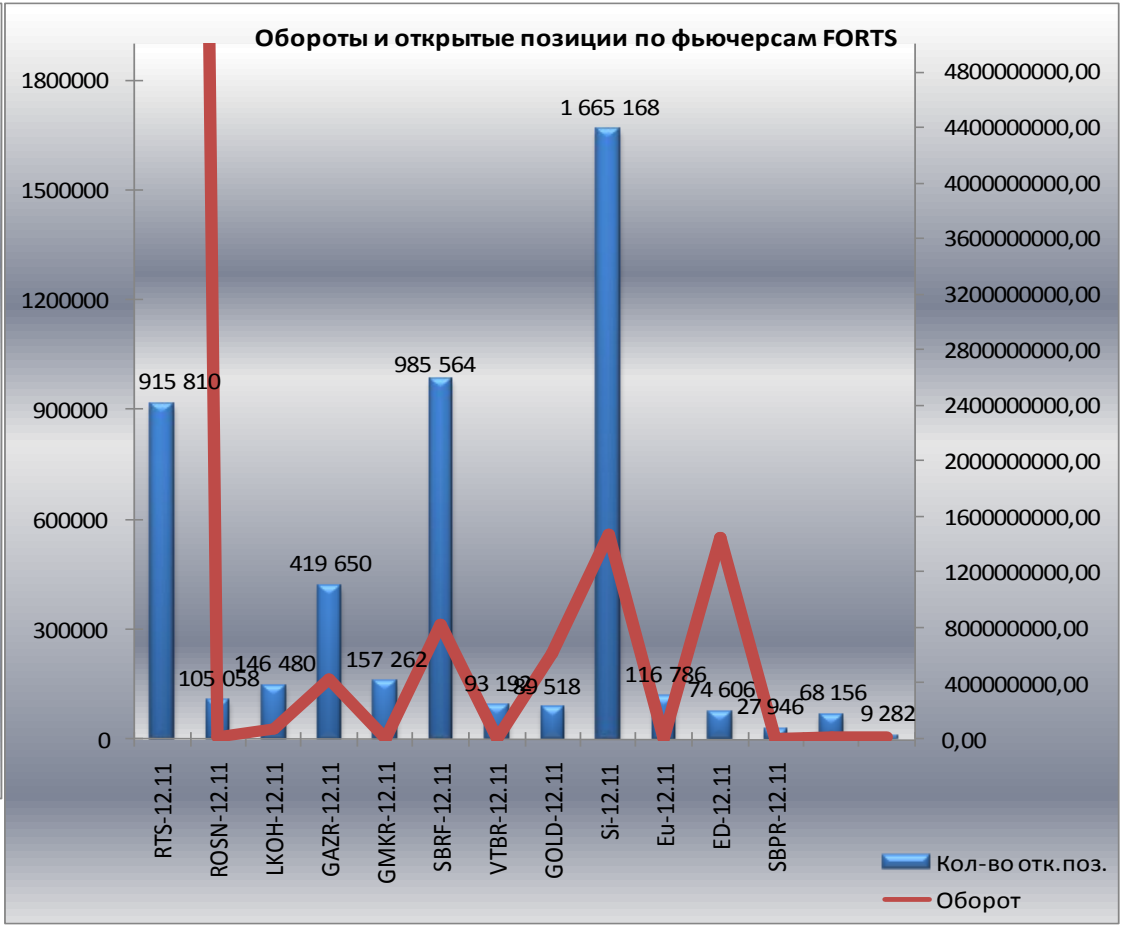


	5750	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750			
OI Call	0	0	0	0	0	2	0	0	40	40	120	180	238	578	402	782	848	1126	24	122
OI Put	112	34	40	84	478	38	260	328	216	916	66	690	1174	1722	640	328	42	102	0	2
IV	108,71	104,78	91,516	86,972	82,548	78,332	74,397	70,794	67,553	64,677	62,14	59,876	57,77	55,669	53,527	51,647	50,458	50,048	50,271	50,964


Опционы на Лукойл, октябрь
Волатильность
90
82
74
66
58
50
42
34
26
18
10
500
400
300
200
100
0
1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800 1850 1900 1950 2000
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 6 8 96 122 310 28
OI Put 0 0 0 0 0 0 0 0 4 70 246 162 34 30 0
IV 87,957 65,79 61,727 57,893 54,338 51,096 48,183 45,59 43,284 41,197 39,22 37,224 35,205 33,452 32,327


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
5000
4000
3000
2000
1000
0
100 105 110 115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 254 2032 4878 436 386 170 22 118
OI Put 0 0 0 0 0 0 2 0 2 28 64 158 2282 2146 120 28 32 0 0 0
IV 110,68 104,25 102,20 95,748 89,316 83,032 77,007 71,334 66,086 61,316 57,052 53,3 50,035 47,2 44,697 42,401 40,252 38,43 37,277 36,936


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
RTS-12.11
87,2%
другие
1,8%
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
915 810
105 058
146 480
419 650
157 262
985 564
93 192
89 518
1 665 168
116 786
74 606
27 946
68 156
9 282
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