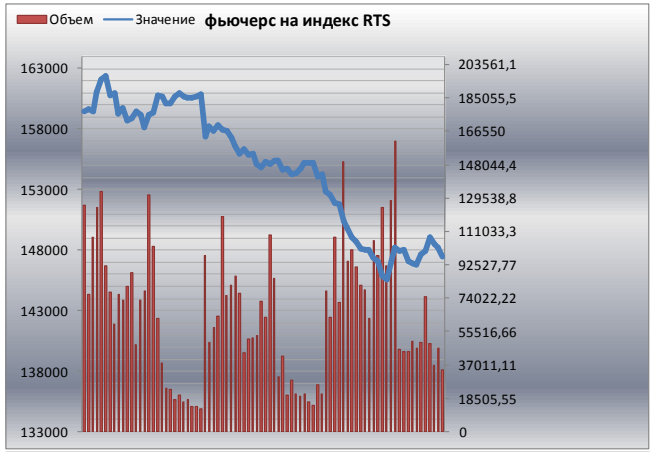
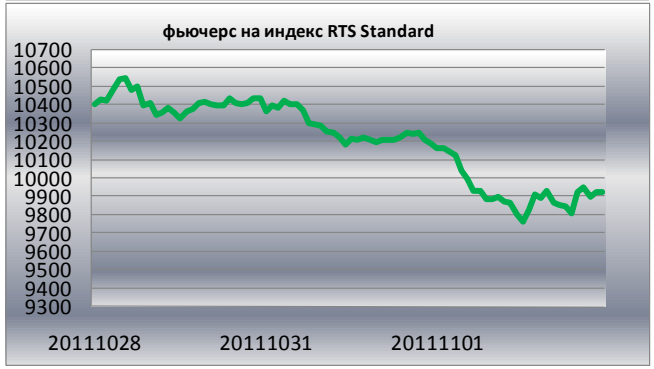
Эксперты не исключают греческий дефолт в самом ближайшем будущем

А.Меркель и Н.Саркози во вторник после телефонных переговоров объявили о проведении в среду чрезвычайного совещания по Греции. Дело в том, что утвержденный раннее план является угрозой для стабильности еврозоны, и агентство Fitch в связи с этим грозится снижением кредитного рейтинга, возможно, не только Греции. Премьер-министр Греции Г.Папандреу заявил во вторник, что вынесет на всеобщий референдум последние решения ЕС относительно греческих долгов, таким «самостоятельным» решением он по сути усугубил и без того настороженные настроения.

Соответственно, попадали как европейские, так и американские индексы, и общая неблагоприятная обстановка оказала влияние на российский рынок: ММВБ упал до 1456,29 пункта (-2,89%), РТС упал до 1484,98 пункта (-5,01%). Динамику "лучше рынка" вновь показали бумаги Седьмого континента (+9,89%, 186,19 руб.), а также Ростелеком (+1,19%, 157,40 руб.)

Что касается металлургического сектора, агентство Moody's снизило рейтинг для европейского стального сектора со "стабильного" на "негативный" из-за ухудшающейся конъюнктуры. Фьючерс на нефть марки Brent к концу дня составил $109,02 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1725,56 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	147485	1474,85	-0,28	727 526	-0,76%	43 312 417 361	23,79%
ROSN-12.11	21229	212,29	0,50	102 438	-0,07%	17 510 826	2,41%
LKOH-12.11	17552	1755,20	0,37	140 318	-0,06%	175 888 862	6,80%
GAZR-12.11	17612	176,12	0,01	384 828	-0,70%	557 515 047	6,52%
GMKR-12.11	56977	5697,70	-0,04	157 472	-0,14%	40 695 717	3,67%
SBRF-12.11	7734	77,34	-0,51	987 120	0,60%	1 089 366 151	11,30%
VTBR-12.11	7170	0,0717	0,74	98 608	11,19%	53 270 944	19,11%
GOLD-12.11	1728	1727,9000	0,69	88 996	-0,65%	219 606 520	7,81%
Si-12.11	30955	30,96	-0,01	1 573 770	0,18%	1 907 015 075	4,86%
Eu-12.11	42574	42,57	0,29	124 450	0,17%	24 175 984	7,49%
ED-12.11	1,37	1,37	0,13	67 998	4,69%	653 426 012	14,56%
SBPR-12.11	6014	60,14	-0,28	31 954	-0,11%	2 835 832	2,68%
RTSS-12.11	9931	9930,50	0,38	74 508	-0,05%	20 683 050	1,79%
BR-12.11	108	107,80	2,80	3 222	-53,25%	32 770 034	102,14%

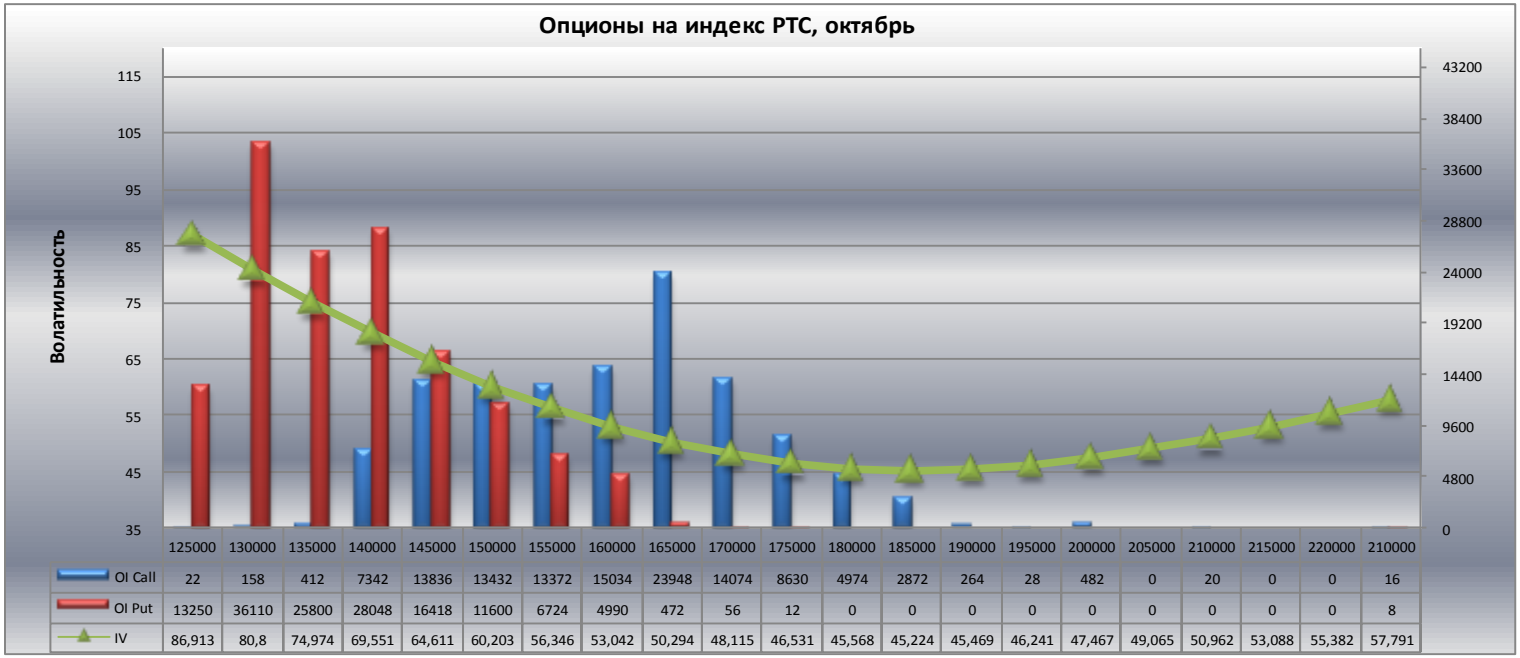
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57322,75	-1,74%	00:12:30
CAC 40	3068,33	-5,38%	19:35:18
DAX 30	5834,51	-5,00%	19:35:31
DJ Industrial	11657,96	-2,49%	00:42:54
FTSE 100	5421,57	-2,21%	19:35:22
Hang Seng	19211,24	-0,82%	10:19:17
Nikkei 225	8665,22	-1,93%	09:00:03
S&P 500	1218,28	-2,79%	00:02:19
Brent 12.11	109,02366	-0,47%	01:09:18
Gold	1725,56	0,80%	10:19:18
Palladium	637,6	0,41%	10:19:25
Platinum	1592,97	0,69%	10:18:11
RTSI	1 481,95	-0,20%	23:50:00
RTS_Standard	9 880,57	-0,03%	23:50:00
RTSI_DEREX	1479,74	-3,42%	18:45:00

Вечерняя сессия

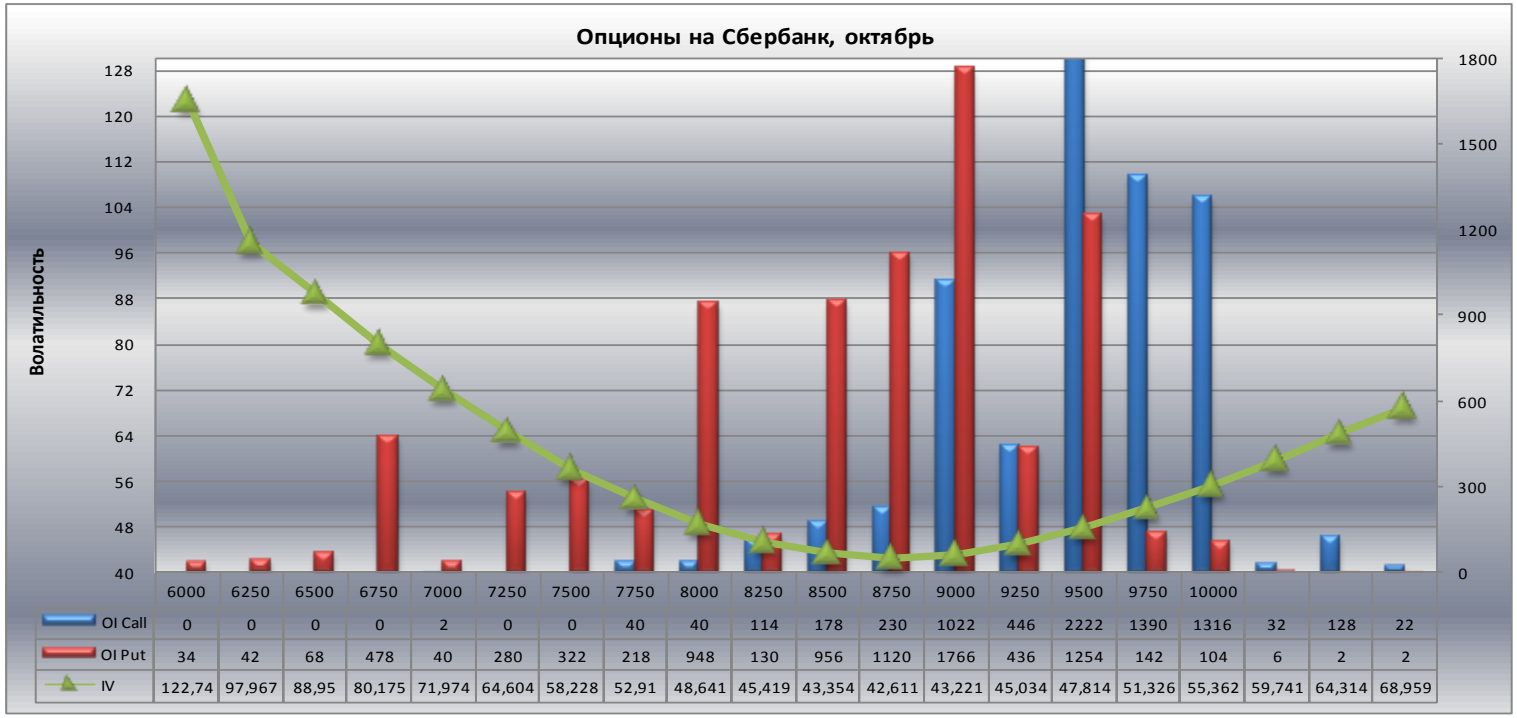
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,28	727526	43312417360,67	147485
ROSN-12.11	0,5	102438	17510826,00	21229
LKOH-12.11	0,37	140318	175888862,00	17552
GAZR-12.11	0,01	384828	557515047,00	17612
GMKR-12.11	-0,04	157472	40695717,00	56977
SBRF-12.11	-0,51	987120	1089366151,00	7734
VTBR-12.11	0,74	98608	53270944,00	7170
GOLD-12.11	0,69	88996	219606519,59	1727,9
Si-12.11	-0,01	1573770	1907015075,00	30955
Eu-12.11	0,29	124450	24175984,00	42574
ED-12.11	0,13	67998	653426011,59	1,3699
SBPR-12.11	-0,28	31954	2835832,00	6014
RTSS-12.11	0,38	74508	20683050,00	9930,5
BR-12.11	2,8	3 222	32770034,49	107,8

Дневная сессия

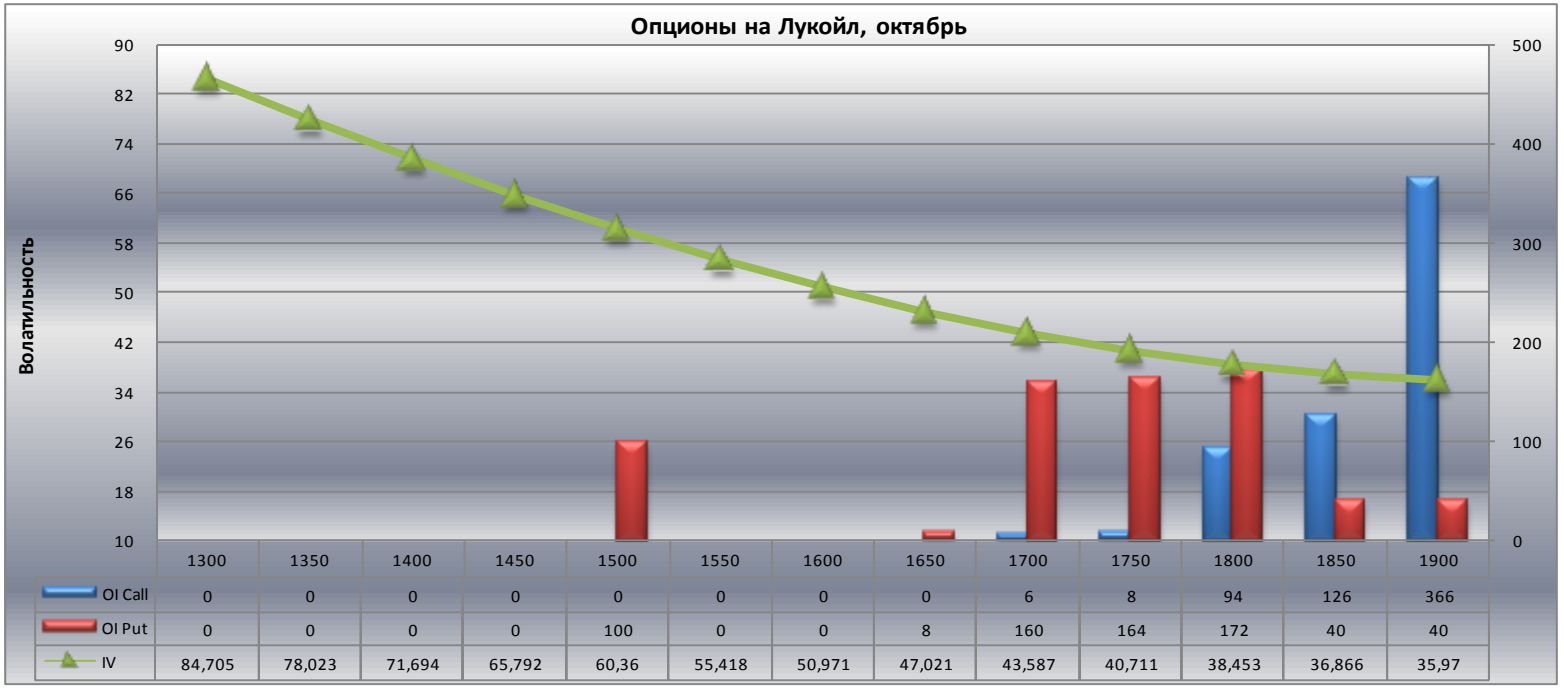
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-4,84	733066	182030985532,81	147900
ROSN-12.11	-3,43	102506	726028100,00	21195
LKOH-12.11	-1,1	140408	2585351376,00	17487
GAZR-12.11	-2,29	387544	8553592037,00	17611
GMKR-12.11	-4,04	157700	1108460643,00	57000
SBRF-12.11	-5,78	981270	9640527145,00	7774
VTBR-12.11	-1,02	88682	278715379,00	7374
GOLD-12.11	-0,71	89574	2812071348,48	1717,8
Si-12.11	1,92	1571000	39262688471,00	30957
Eu-12.11	-0,09	124234	322665487,00	42450
ED-12.11	-2,17	64954	4489254866,33	1,3681
SBPR-12.11	-6,13	31988	105670485,00	6031
RTSS-12.11	-3,12	74548	1155321070,00	9892,5
BR-12.11	-1,53	6 892	32082347,37	106,3

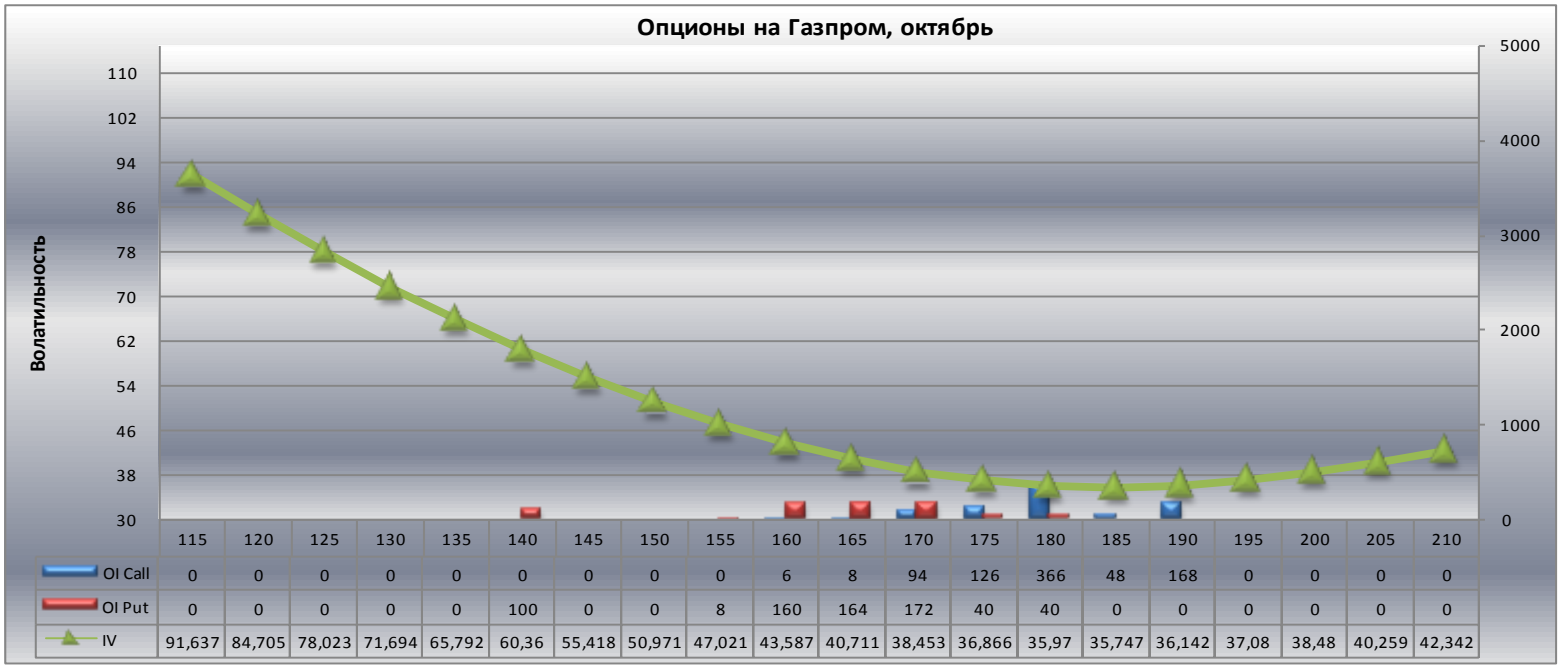


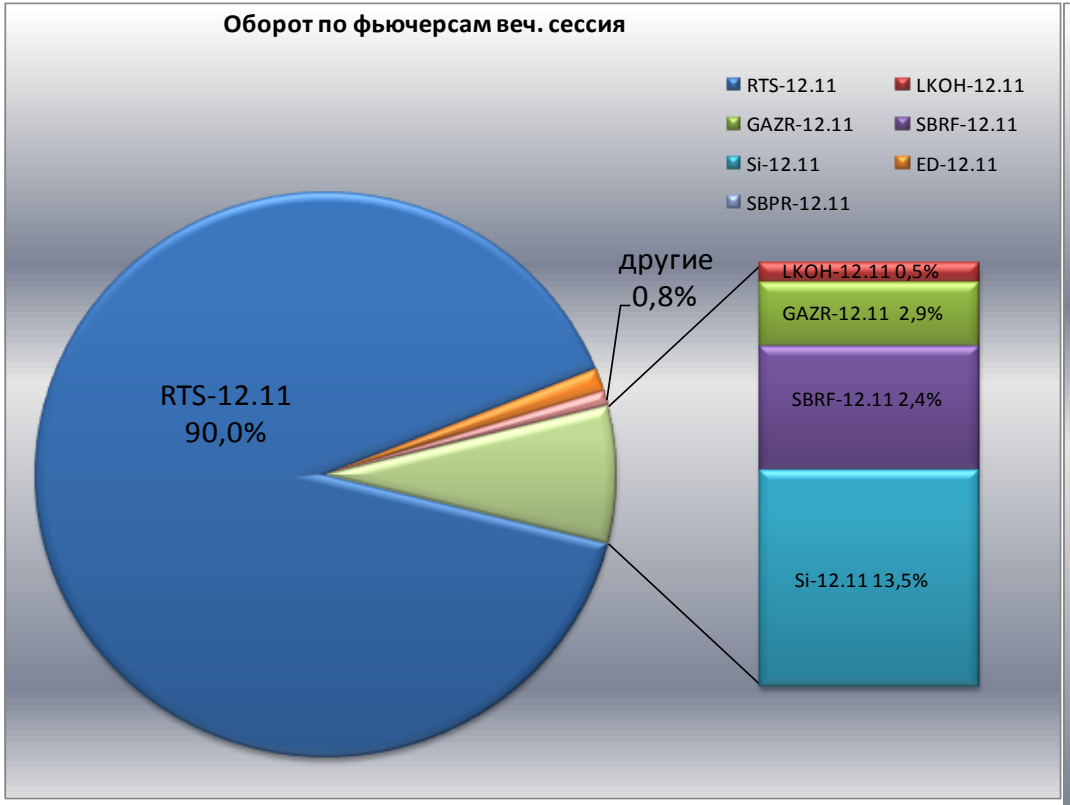
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	22	158	412	7342	13836	13432	13372	15034	23948	14074	8630	4974	2872	264	28	482	0	20	0	0	16
OI Put	13250	36110	25800	28048	16418	11600	6724	4990	472	56	12	0	0	0	0	0	0	0	0	0	8
IV	86,913	80,8	74,974	69,551	64,611	60,203	56,346	53,042	50,294	48,115	46,531	45,568	45,224	45,469	46,241	47,467	49,065	50,962	53,088	55,382	57,791

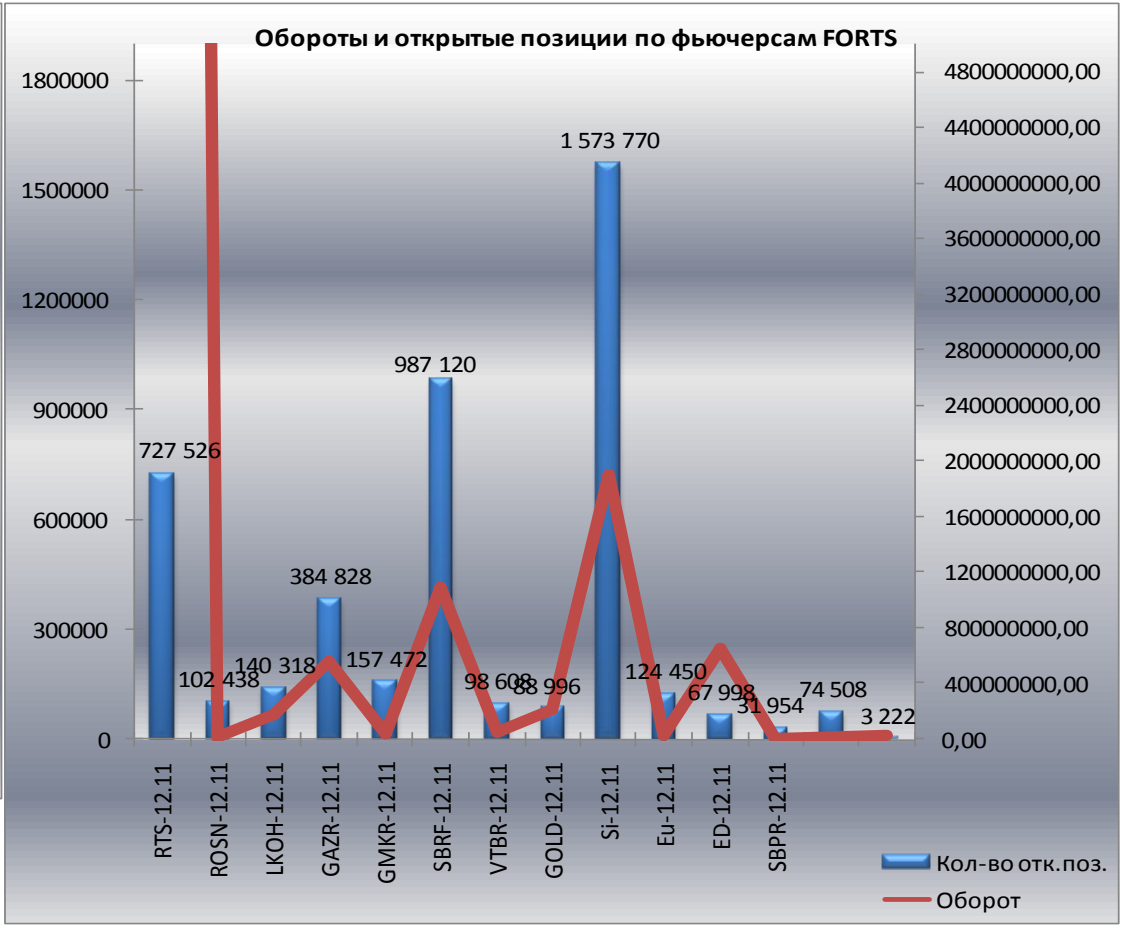


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	2	0	0	40	40	114	178	230	1022	446	2222	1390	1316	32	128	22
OI Put	34	42	68	478	40	280	322	218	948	130	956	1120	1766	436	1254	142	104	6	2	2
IV	122,74	97,967	88,95	80,175	71,974	64,604	58,228	52,91	48,641	45,419	43,354	42,611	43,221	45,034	47,814	51,326	55,362	59,741	64,314	68,959


Опционы на Лукойл, октябрь
Волатильность
90
82
74
66
58
50
42
34
26
18
10
500
400
300
200
100
0
1300 1350 1400 1450 1500 1550 1600 1650 1700 1750 1800 1850 1900
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 6 8 94 126 366
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 8 160 164 172 40 40
IV 84,705 78,023 71,694 65,792 60,36 55,418 50,971 47,021 43,587 40,711 38,453 36,866 35,97


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
5000
4000
3000
2000
1000
0
115 120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200 205 210
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 0 6 8 94 126 366 48 168 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 100 0 0 8 160 164 172 40 40 0 0 0 0 0 0
IV 91,637 84,705 78,023 71,694 65,792 60,36 55,418 50,971 47,021 43,587 40,711 38,453 36,866 35,97 35,747 36,142 37,08 38,48 40,259 42,342


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
90,0%
другие
0,8%
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
727 526
102 438
140 318
384 828
157 472
987 120
98 608
88 996
1 573 770
124 450
67 998
31 954
74 508
3 222
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