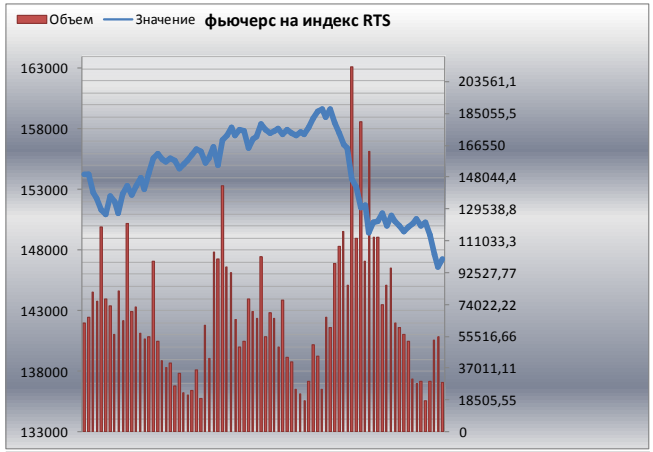
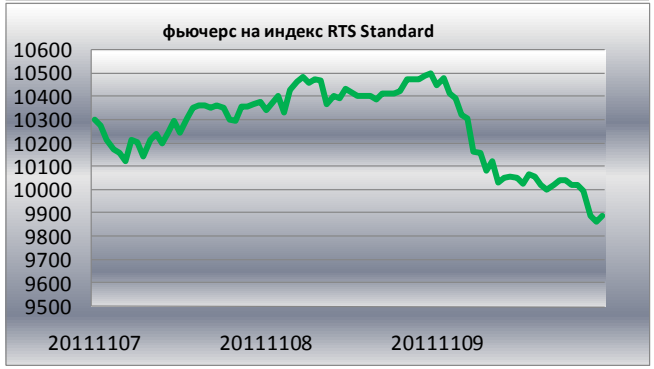
Тревожные настроения только усиливаются

Коротко о новостях из запада: Премьер-министр Греции Георгис Папандреу уходит в отставку. Доходность 10-летних гособлигаций превысила психологически важную отметку в 7% , следует заметить, что у Италии доходность бондов еще никогда не была такой высокой. Индекс волатильности VIX выстрелил почти на 32%, демонстрируя высокий уровень тревожности на фондовом рынке. На фоне панических настроений, фондовые рынки США и Европы закончили сессию в сильном минусе: FTSE100 –1,92%, DAX –2,21%, CAC40 –2,17% и Dow-Jones –3,20%, S&P500 –3,67% .

Фьючерс на нефть марки Brent к концу дня составил $112,27 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1760,25 за тройскую унцию.

По итогам дня российские биржи просели более чем на 3%: ММВБ - (-3,29%, 1470,80 пунктов), РТС - (-4,24%, 1512,85 пунктов).





	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	147225	1472,25	-1,82	795 886	-0,47%	34 567 026 904	16,14%
ROSN-12.11	21998	219,98	-1,09	98 744	-0,08%	25 722 049	2,88%
LKOH-12.11	17520	1752,00	-1,24	151 612	-1,07%	148 927 885	5,63%
GAZR-12.11	17897	178,97	-1,75	349 206	-2,04%	649 414 231	8,13%
GMKR-12.11	55082	5508,20	-1,51	137 362	0,14%	43 250 965	6,10%
SBRF-12.11	7830	78,30	-1,07	942 002	1,17%	790 686 544	6,58%
VTBR-12.11	7085	0,0709	-1,65	90 006	-5,13%	27 558 832	11,67%
GOLD-12.11	1780	1780,3000	-0,72	81 934	-2,11%	313 851 109	27,24%
Si-12.11	30934	30,93	0,39	1 638 200	0,56%	2 148 472 885	4,72%
Eu-12.11	41903	41,90	0,15	124 786	0,08%	13 498 102	11,99%
ED-12.11	1,35	1,35	-0,37	73 542	1,82%	979 329 625	18,01%
SBPR-12.11	6212	62,12	-1,19	54 728	-1,08%	6 093 657	8,13%
RTSS-12.11	9889	9889,00	-1,33	72 922	0,06%	27 936 175	3,39%
BR-12.11	108	107,80	2,80	3 222	-44,45%	32 770 034	18,44%

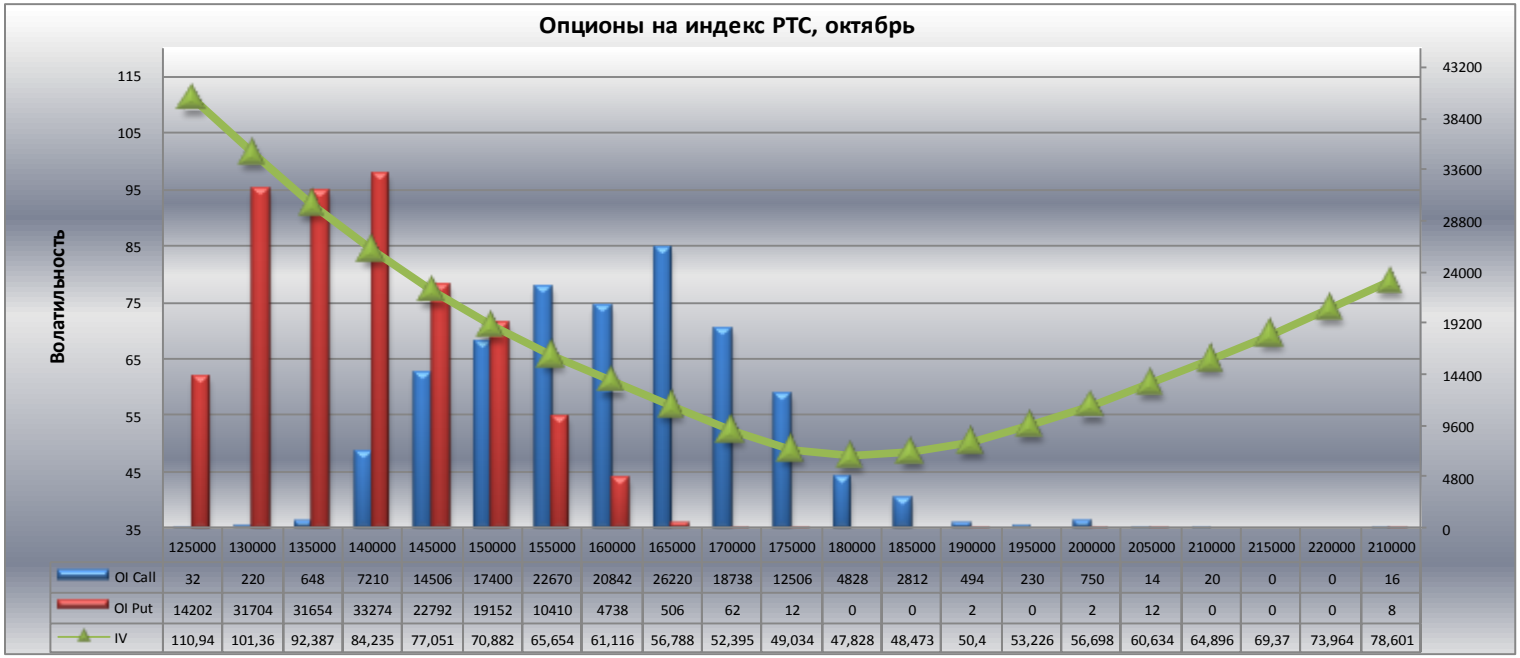
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57549,74	-2,50%	00:12:30
CAC 40	3075,16	-2,17%	19:35:18
DAX 30	5829,54	-2,21%	19:35:31
DJ Industrial	11780,94	-3,20%	00:42:54
FTSE 100	5460,38	-1,92%	19:35:22
Hang Seng	19128,25	-4,43%	10:19:17
Nikkei 225	8518,75	-2,70%	09:00:03
S&P 500	1229,1	-3,67%	00:02:19
Brent 12.11	112,27	-0,04%	01:09:18
Gold	1760,27	-1,75%	10:19:18
Palladium	644,6	-1,57%	10:19:25
Platinum	1620,5	-1,41%	10:18:11
RTSI	1 502,28	-0,70%	23:50:00
RTS_Standard	9 910,40	-0,97%	23:50:00
RTSI_DEREX	1479,74	-3,42%	18:45:00

Вечерняя сессия

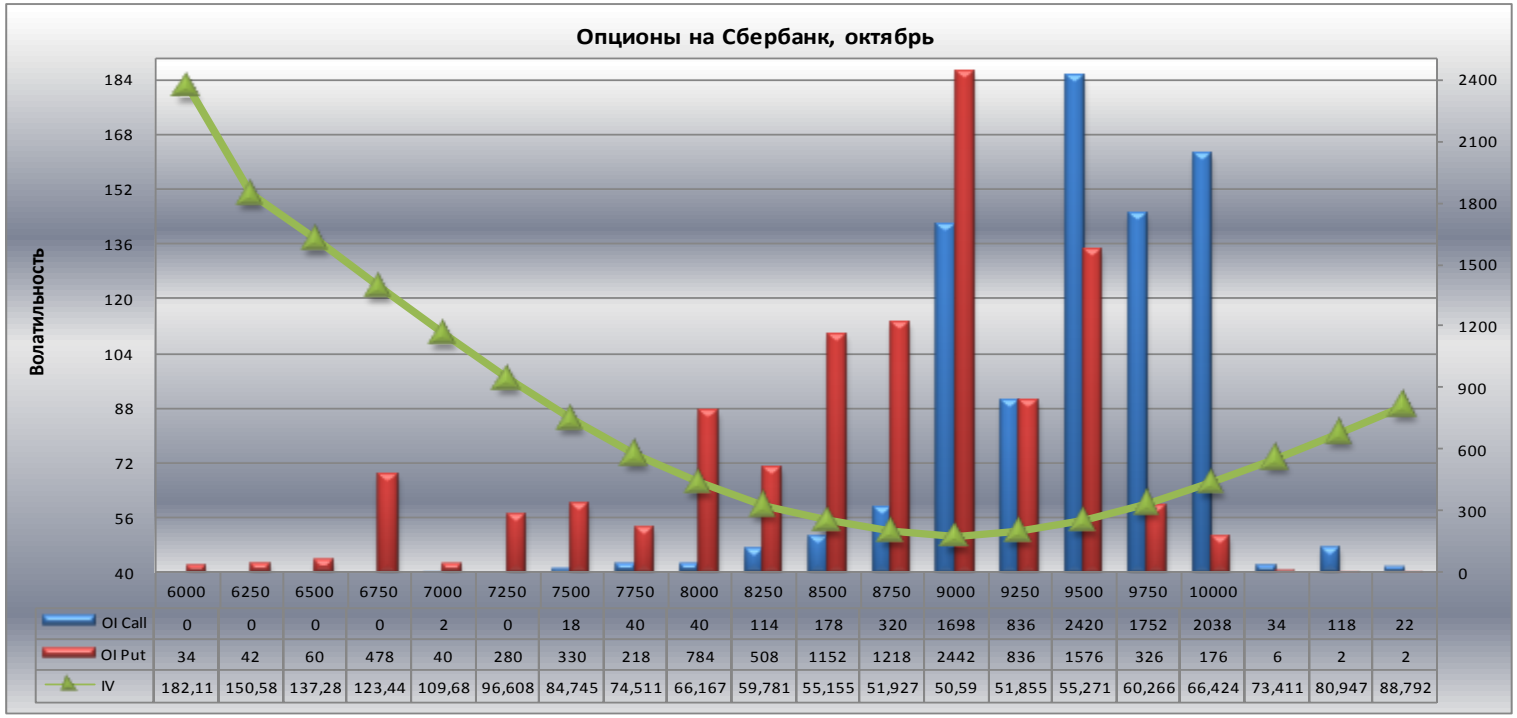
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-1,82	795886	34567026903,79	147225
ROSN-12.11	-1,09	98744	25722049,00	21998
LKOH-12.11	-1,24	151612	148927885,00	17520
GAZR-12.11	-1,75	349206	649414231,00	17897
GMKR-12.11	-1,51	137362	43250965,00	55082
SBRF-12.11	-1,07	942002	790686544,00	7830
VTBR-12.11	-1,65	90006	27558832,00	7085
GOLD-12.11	-0,72	81934	313851108,60	1780,3
Si-12.11	0,39	1638200	2148472885,00	30934
Eu-12.11	0,15	124786	13498102,00	41903
ED-12.11	-0,37	73542	979329624,97	1,3538
SBPR-12.11	-1,19	54728	6093657,00	6212
RTSS-12.11	-1,33	72922	27936175,00	9889
BR-12.11	2,8	3 222	32770034,49	107,8

Дневная сессия

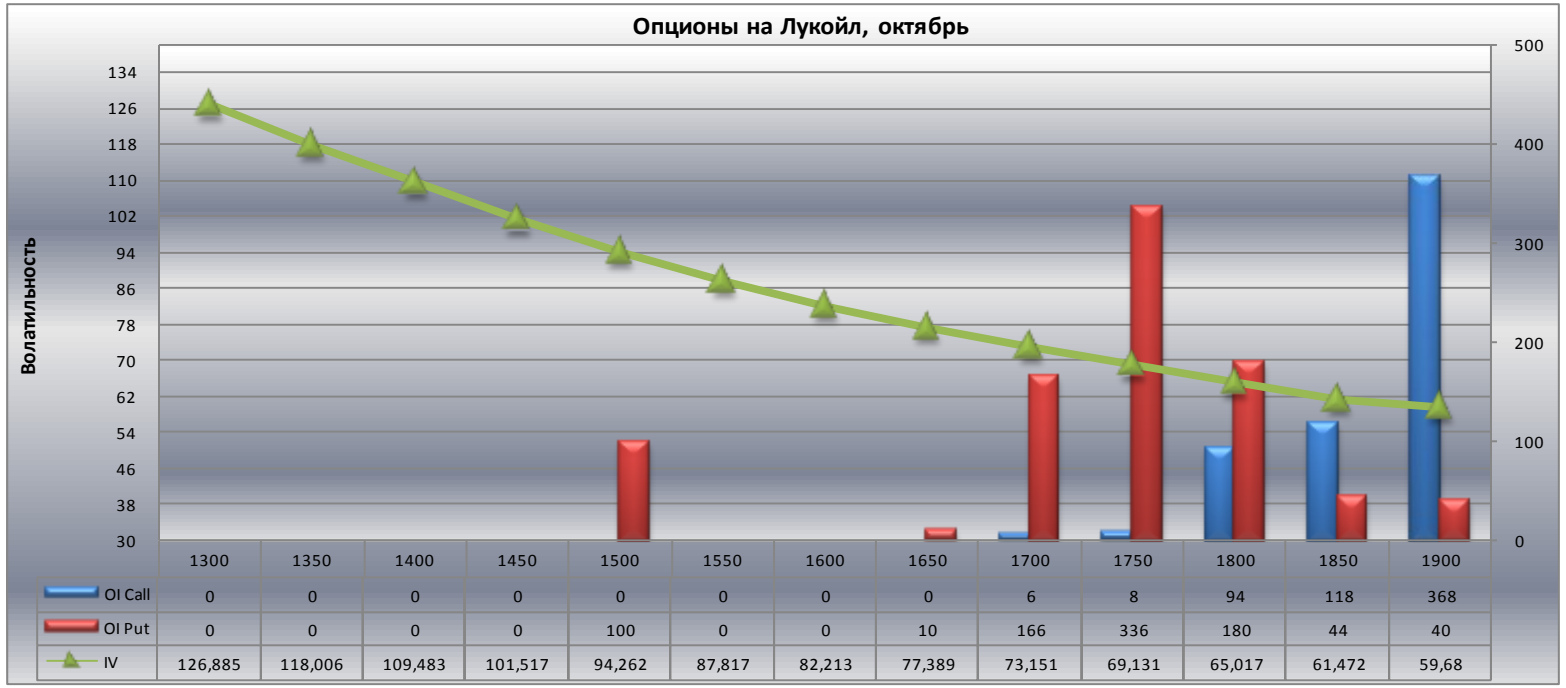
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-5,09	799628	214117980041,94	149950
ROSN-12.11	-2,28	98828	891732547,00	22241
LKOH-12.11	-1,86	153248	2645532605,00	17740
GAZR-12.11	-1,3	356468	7987523226,00	18216
GMKR-12.11	-5,21	137170	709518230,00	55925
SBRF-12.11	-6,52	931076	12016536598,00	7915
VTBR-12.11	1,43	94868	236189750,00	7219
GOLD-12.11	-0,37	83698	1152001581,56	1793,2
Si-12.11	1,47	1629030	45483470030,00	30813
Eu-12.11	-0,32	124688	112580269,00	41840
ED-12.11	-1,63	72230	5436197726,59	1,3588
SBPR-12.11	-4,74	55326	74935596,00	6290
RTSS-12.11	-3,66	72878	822871385,00	10022
BR-12.11	-2,01	5 800	177747644,57	112,05

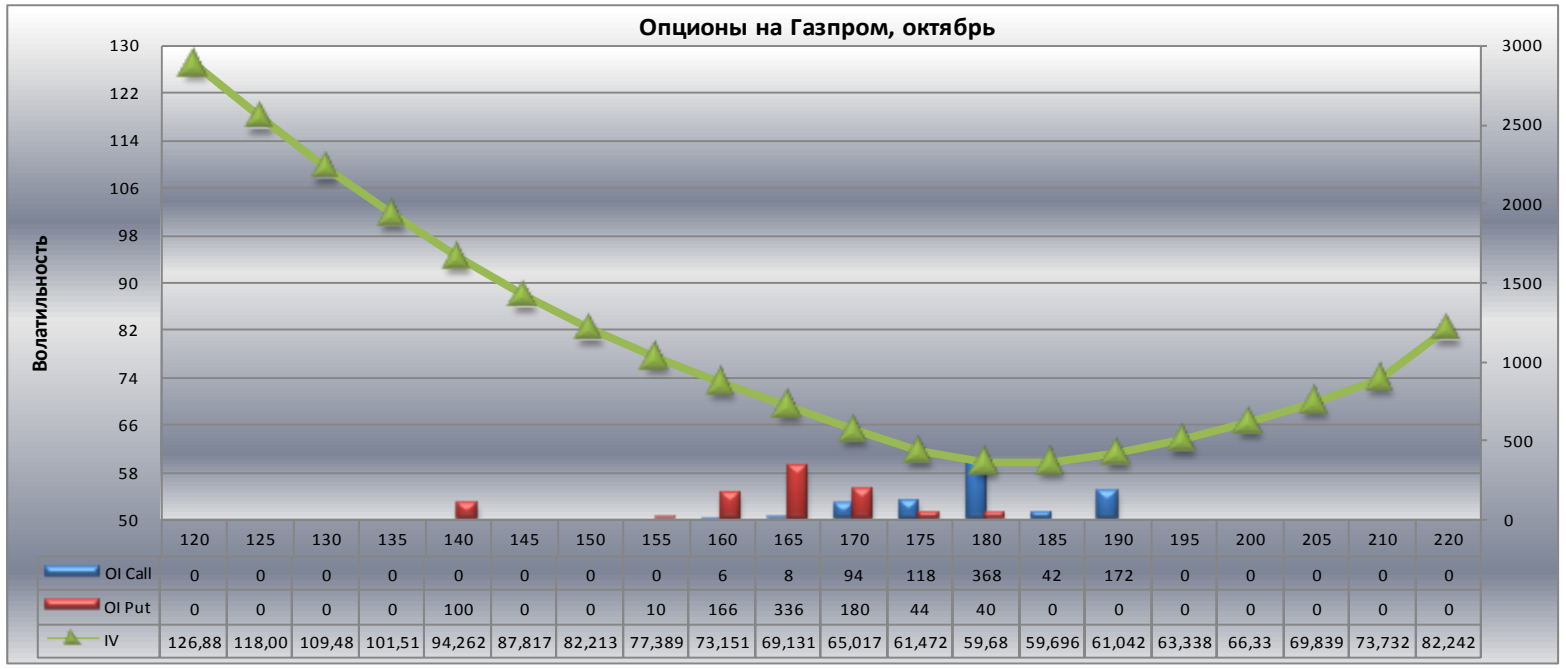


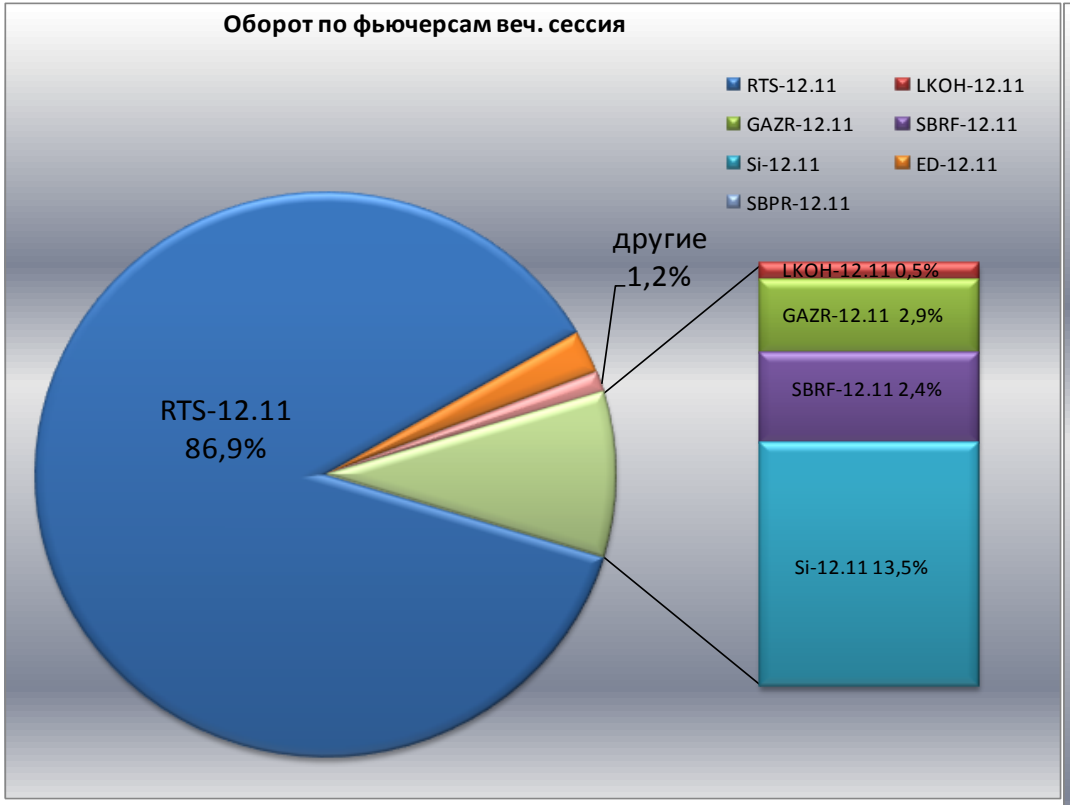
	125000	130000	135000	140000	145000	150000	155000	160000	165000	170000	175000	180000	185000	190000	195000	200000	205000	210000	215000	220000	210000
OI Call	32	220	648	7210	14506	17400	22670	20842	26220	18738	12506	4828	2812	494	230	750	14	20	0	0	16
OI Put	14202	31704	31654	33274	22792	19152	10410	4738	506	62	12	0	0	2	0	2	12	0	0	0	8
IV	110,94	101,36	92,387	84,235	77,051	70,882	65,654	61,116	56,788	52,395	49,034	47,828	48,473	50,4	53,226	56,698	60,634	64,896	69,37	73,964	78,601

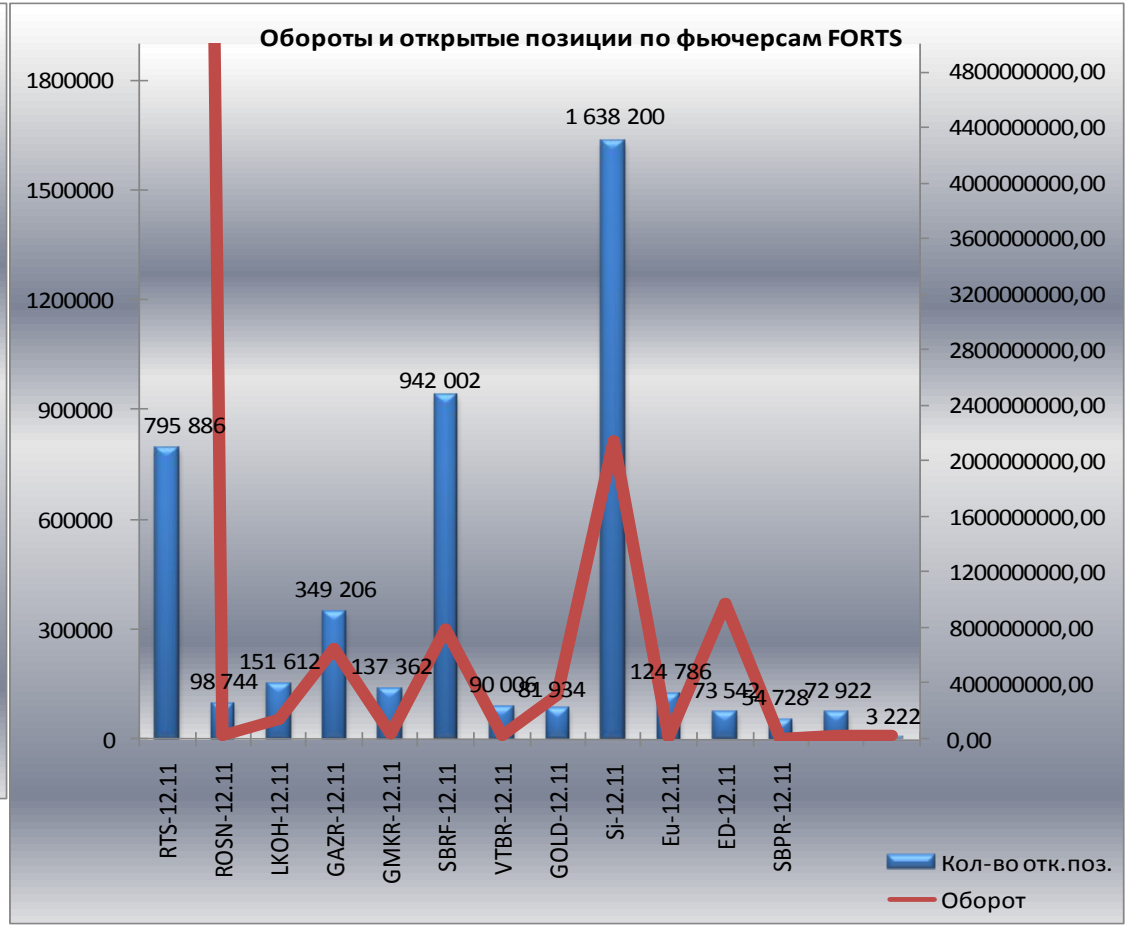


	6000	6250	6500	6750	7000	7250	7500	7750	8000	8250	8500	8750	9000	9250	9500	9750	10000			
OI Call	0	0	0	0	2	0	18	40	40	114	178	320	1698	836	2420	1752	2038	34	118	22
OI Put	34	42	60	478	40	280	330	218	784	508	1152	1218	2442	836	1576	326	176	6	2	2
IV	182,11	150,58	137,28	123,44	109,68	96,608	84,745	74,511	66,167	59,781	55,155	51,927	50,59	51,855	55,271	60,266	66,424	73,411	80,947	88,792


Опционы на Лукойл, октябрь
Волатильность
134
126
118
110
102
94
86
78
70
62
54
46
38
30
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 94 118 368
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 10 166 336 180 44 40
IV 126,885 118,006 109,483 101,517 94,262 87,817 82,213 77,389 73,151 69,131 65,017 61,472 59,68


Опционы на Газпром, октябрь
Волатильность
130
122
114
106
98
90
82
74
66
58
50
3000
2500
2000
1500
1000
500
0
120 125 130 135 140 145 150 155 160 165 170 175 180 185 190 195 200 205 210 220
OI Call 0 0 0 0 0 0 0 0 6 8 94 118 368 42 172 0 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 10 166 336 180 44 40 0 0 0 0 0 0 0
IV 126,88 118,00 109,48 101,51 94,262 87,817 82,213 77,389 73,151 69,131 65,017 61,472 59,68 59,696 61,042 63,338 66,33 69,839 73,732 82,242


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
1,2%
RTS-12.11
86,9%
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
795 886
98 744
151 612
349 206
137 362
942 002
90 006
81 934
1 638 200
124 786
73 542
54 728
72 922
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