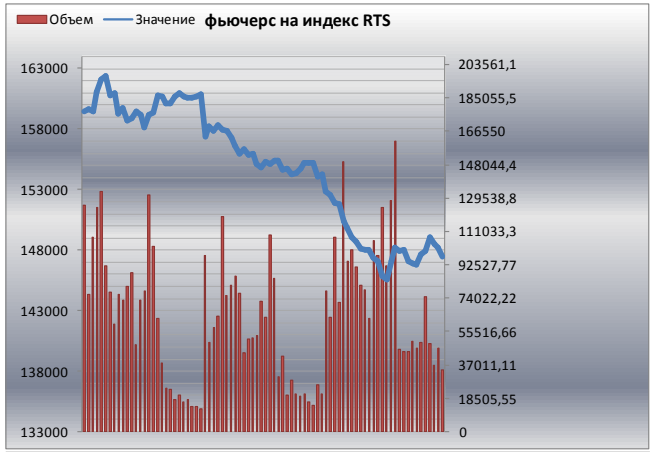
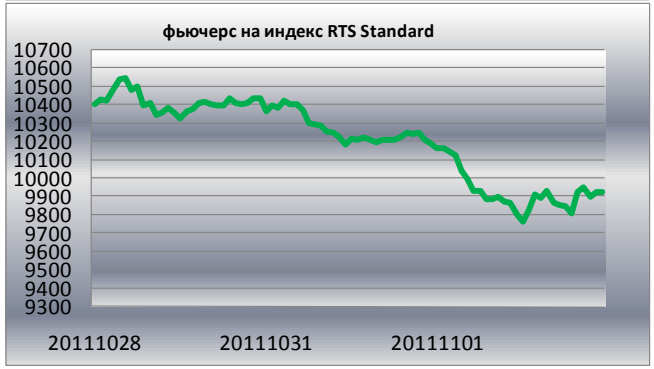
Греческий дефолт становится все более вероятным

После экстренного заседания между лидерами ЕС было решено, что Греция не получит финпомощь до тех пор, пока не будут подведены итоги референдума. Греция проведет референдум ориентировочно 4 декабря, до этого денег от ЕС и МВФ не получит. Помимо решения о «замораживании» финпомощи для Греции, лидеры Германии и Франции заявили накануне о приоритетности стабилизации общей валюты, евро, над сохранением членства Греции в еврозоне. Существует вероятность того, что в случае выхода Греции из ЕС, это за собой повлечет выход из зоны ЕС также других стран, таких как Италия, Испания, Португалия, Ирландия, Мальта, Кипр.

К тому же, дешевеет нефть на фоне значительно укрепившегося доллара и возросшей неопределенности вокруг ситуации с кризисом в ЕС: фьючерс на нефть марки Brent к концу дня составил $108,32 за баррель. Золото с поставкой в декабре на COMEX составило $1729,19 за тройскую унцию.

На российском рынке наблюдался рост после двух дней довольно сильного падения, тем не менее говорить об уверенном развороте наверх ещё рано.





	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	152000	1520,00	-0,02	727 526	-3,27%	43 312 417 361	23,10%
ROSN-12.11	21984	219,84	-0,14	102 438	1,86%	17 510 826	6,00%
LKOH-12.11	17700	1770,00	-2,03	140 318	-0,59%	175 888 862	8,74%
GAZR-12.11	18369	183,69	-0,15	383 924	-0,10%	442 806 829	5,33%
GMKR-12.11	57977	5797,70	-2,81	157 472	5,89%	40 695 717	4,36%
SBRF-12.11	7948	79,48	-0,09	987 120	3,99%	1 089 366 151	11,04%
VTBR-12.11	7219	0,0722	0,84	98 608	3,94%	53 270 944	22,55%
GOLD-12.11	1750	1749,5000	-0,35	88 996	-11,81%	219 606 520	10,98%
Si-12.11	30781	30,78	0,30	1 573 770	6,85%	1 907 015 075	6,00%
Eu-12.11	42418	42,42	-0,22	124 450	0,95%	24 175 984	32,30%
ED-12.11	1,38	1,38	0,13	67 998	11,28%	653 426 012	15,67%
SBPR-12.11	6180	61,80	0,16	31 954	-10,46%	2 835 832	1,28%
RTSS-12.11	10159	10158,50	0,29	74 508	2,12%	20 683 050	4,68%
BR-12.11	109	109,49	-1,59	3 222	-50,28%	32 770 034	116,33%

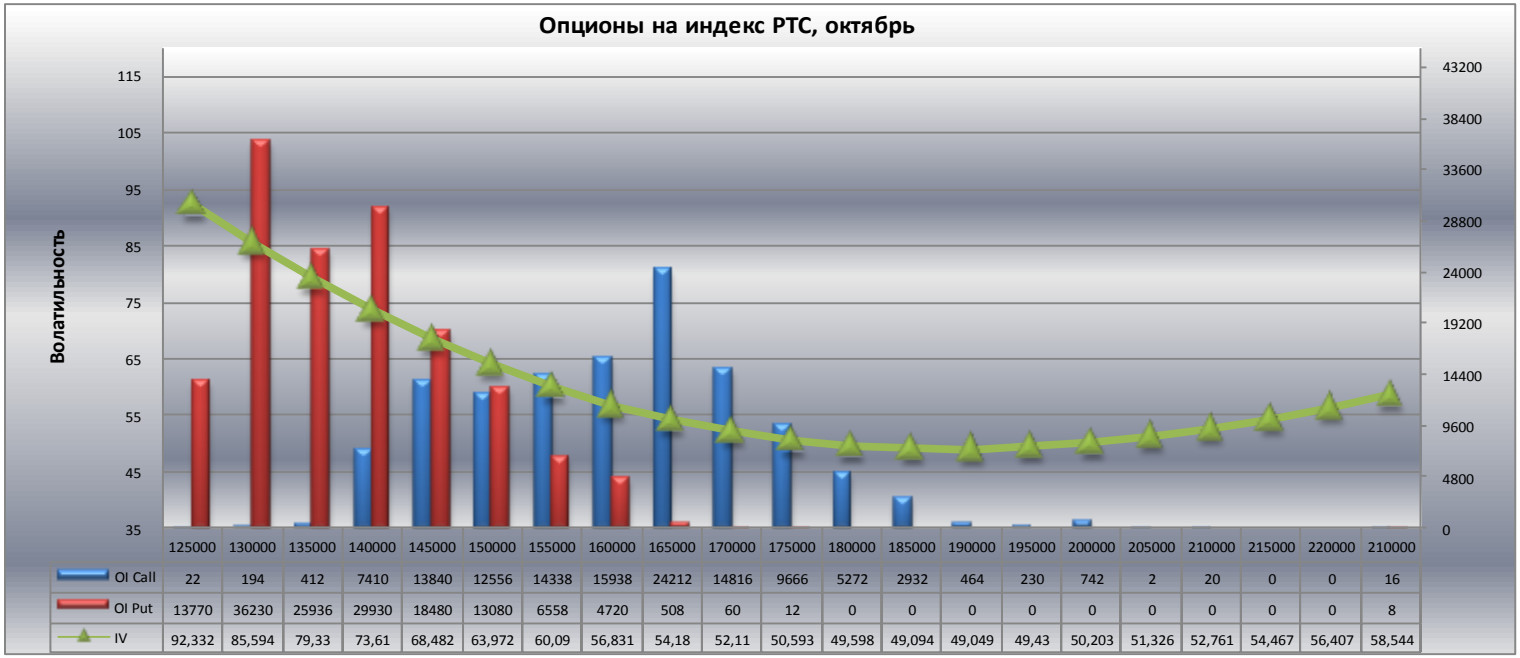
	Закрытие	Изменение %	Время
BOVESPA Brazil	57322,75	-1,74%	00:12:30
CAC 40	3110,59	1,38%	19:35:18
DAX 30	5965,63	2,25%	19:35:31
DJ Industrial	11836,04	1,53%	00:42:54
FTSE 100	5484,1	1,15%	19:35:22
Hang Seng	19245,53	-2,47%	10:19:17
Nikkei 225	8640,42	-2,21%	09:00:03
S&P 500	1237,9	1,61%	00:02:19
Brent 12.11	108,32446	-0,93%	01:09:18
Gold	1729,19	-0,02%	10:19:18
Palladium	641,7	-1,07%	10:19:25
Platinum	1593,4	-0,49%	10:18:11
RTSI	1 524,29	-0,12%	23:50:00
RTS_Standard	10 118,52	0,07%	23:50:00
RTSI_DEREX	1479,74	-3,42%	18:45:00

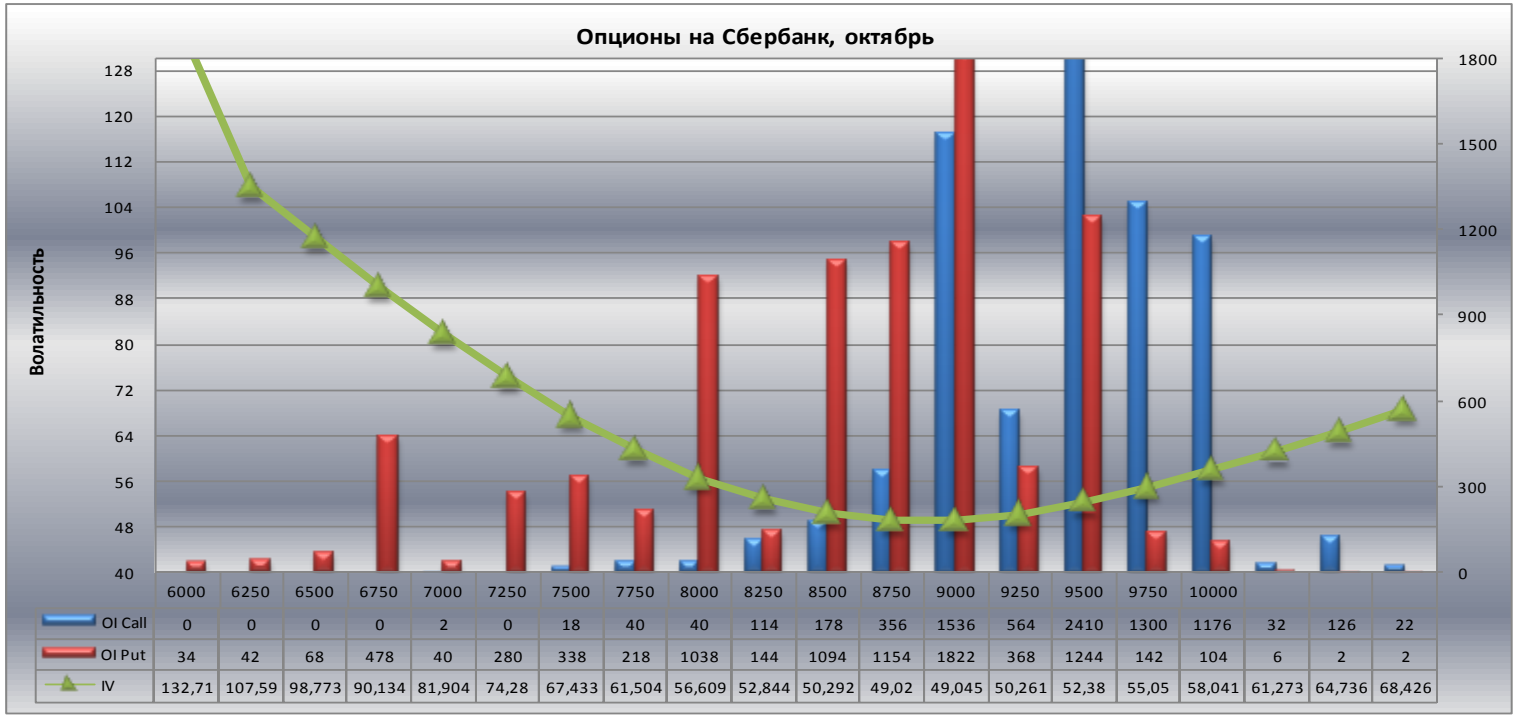
Вечерняя сессия

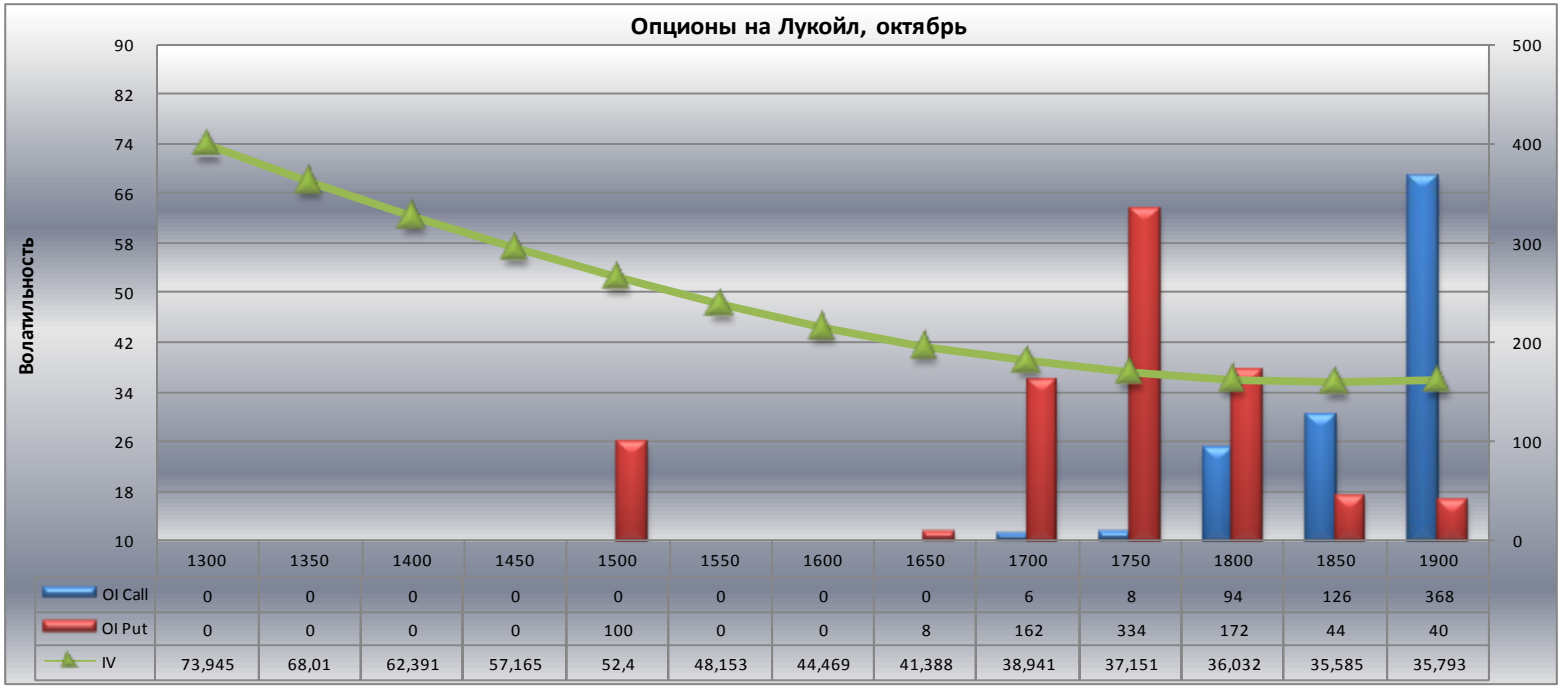
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	-0,02	727526	43312417360,67	152 000
ROSN-12.11	-0,14	102438	17510826,00	21 984
LKOH-12.11	-2,03	140318	175888862,00	17 700
GAZR-12.11	-0,15	383 924	442806829,00	18 369
GMKR-12.11	-2,81	157472	40695717,00	57 977
SBRF-12.11	-0,09	987120	1089366151,00	7 948
VTBR-12.11	0,84	98608	53270944,00	7 219
GOLD-12.11	-0,35	88996	219606519,59	1 749,50
Si-12.11	0,3	1573770	1907015075,00	30 781
Eu-12.11	-0,22	124450	24175984,00	42 418
ED-12.11	0,13	67998	653426011,59	1,3781
SBPR-12.11	0,16	31954	2835832,00	6 180
RTSS-12.11	0,29	74508	20683050,00	10 159
BR-12.11	-1,59	3 222	32770034,49	109,49

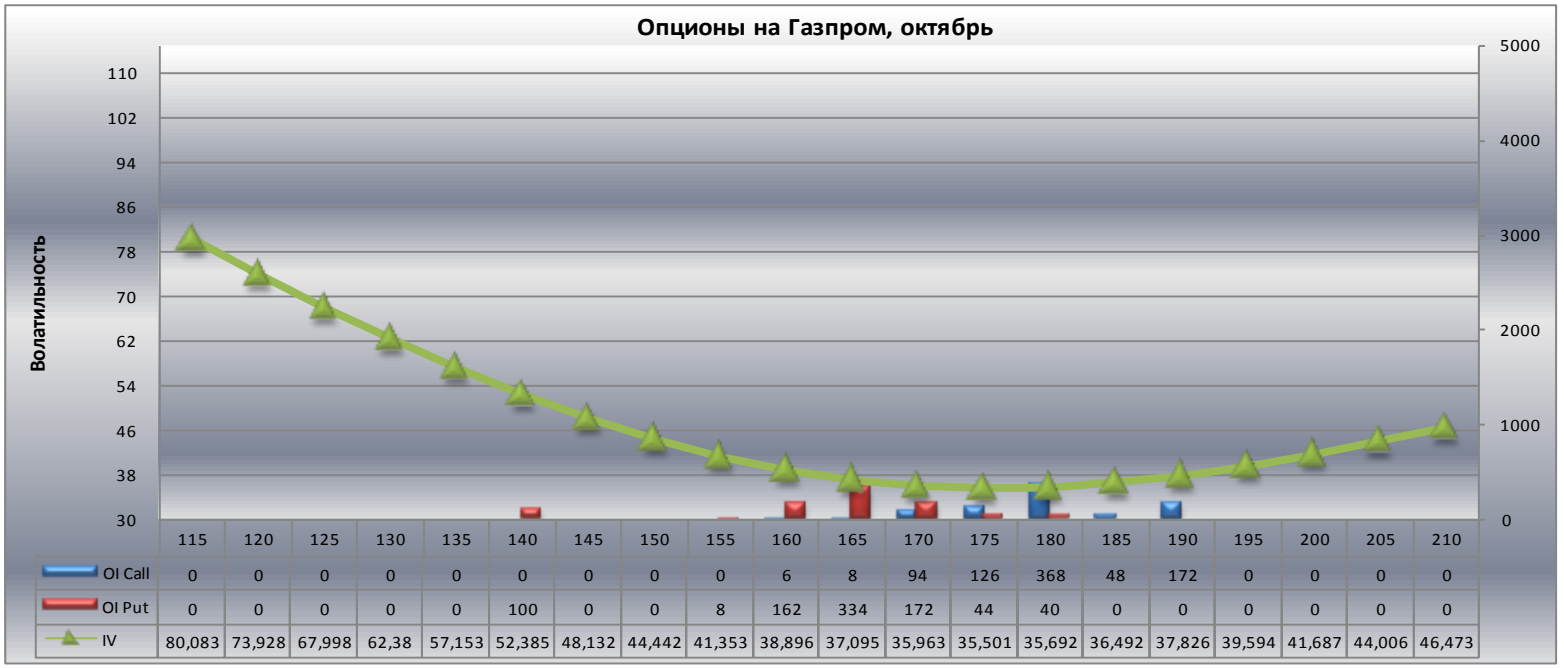
Дневная сессия

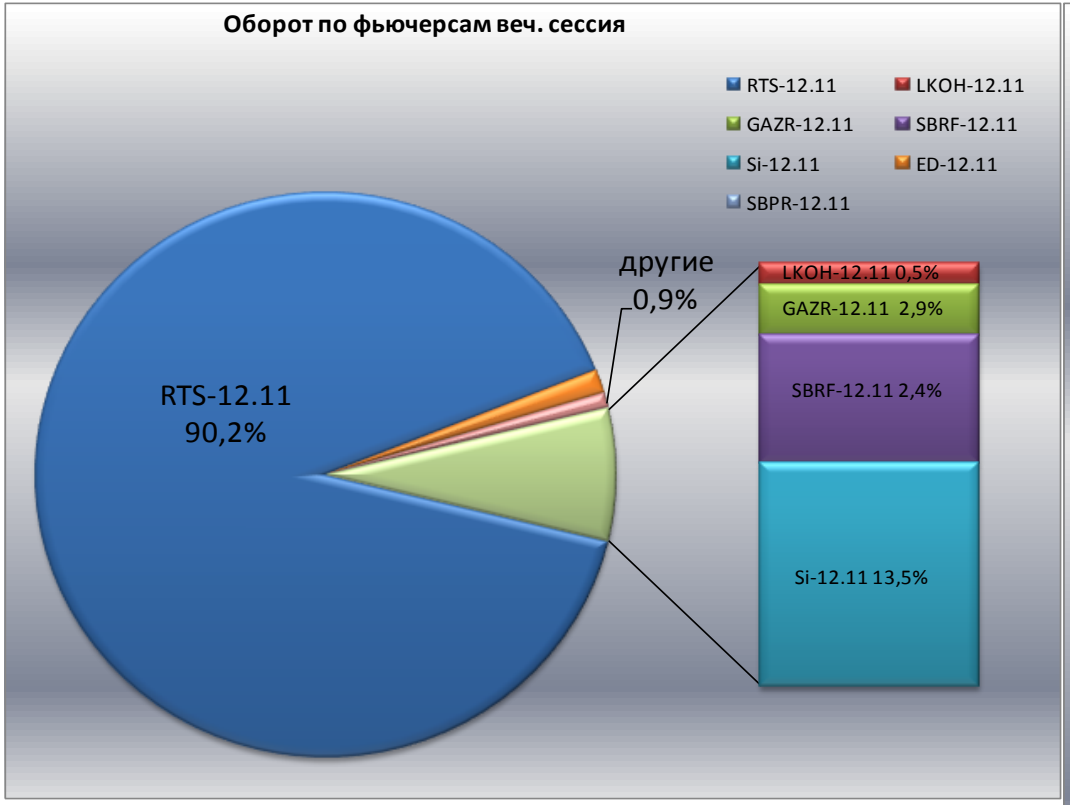
	% измен.закр.	Кол-во отк.поз.	Оборот	Расч. цена
RTS-12.11	2,77	752082	187527370595,71	152000
ROSN-12.11	3,72	100564	291626667,00	21984
LKOH-12.11	1,22	141150	2013430781,00	17700
GAZR-12.11	4,31	384326	8300900615,00	18370
GMKR-12.11	1,76	148706	933848146,00	58006
SBRF-12.11	2,25	949270	9871154293,00	7949
VTBR-12.11	1,43	94868	236189750,00	7219
GOLD-12.11	1,87	100914	2000691333,09	1750
Si-12.11	-0,57	1472936	31773709976,00	30781
Eu-12.11	-0,08	123278	74850347,00	42418
ED-12.11	0,73	61108	4169449137,26	1,3781
SBPR-12.11	2,47	35688	220924240,00	6180
RTSS-12.11	2,39	72958	441615825,00	10129
BR-12.11	3	6 480	28168797,95	109,49

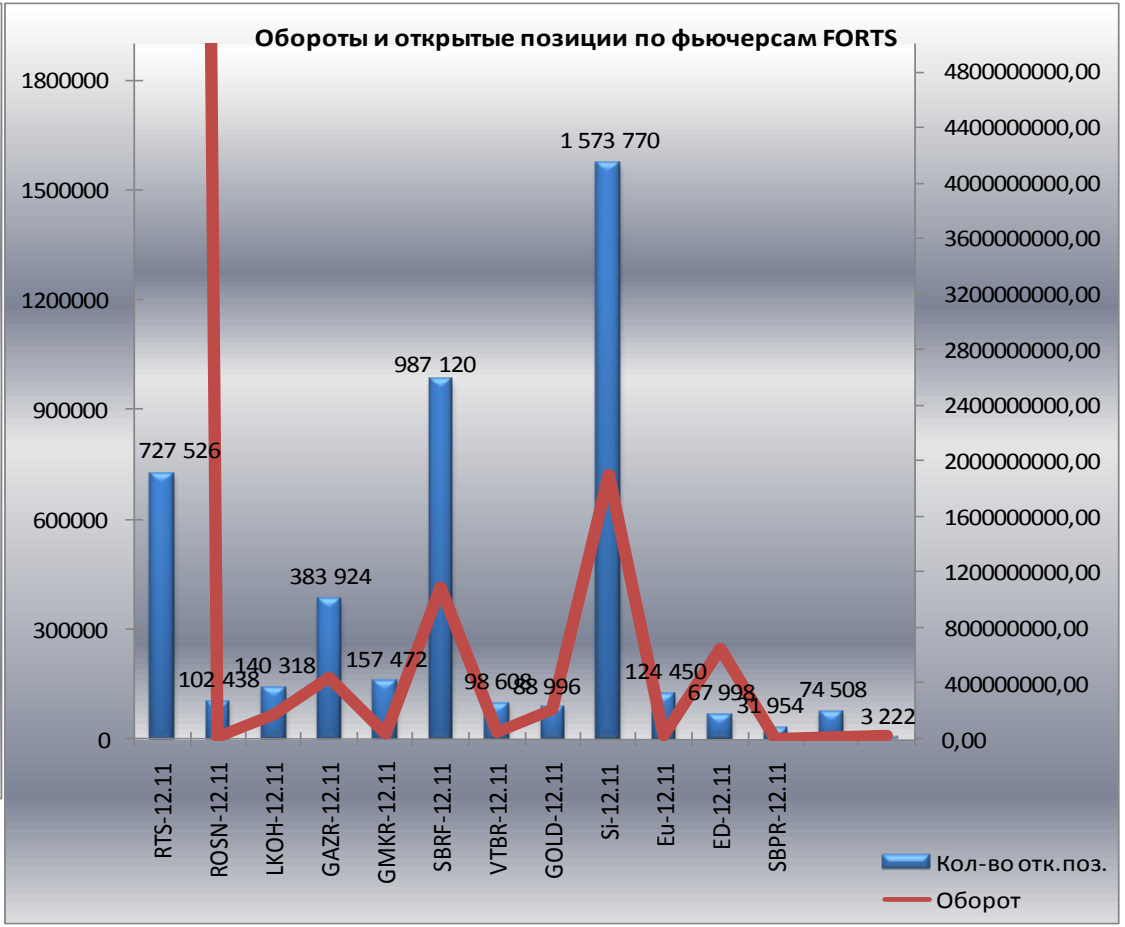

Опционы на индекс РТС, октябрь
Волатильность
115
105
95
85
75
65
55
45
35
43200
38400
33600
28800
24000
19200
14400
9600
4800
0
125000 130000 135000 140000 145000 150000 155000 160000 165000 170000 175000 180000 185000 190000 195000 200000 205000 210000 215000 220000 210000
OI Call 22 194 412 7410 13840 12556 14338 15938 24212 14816 9666 5272 2932 464 230 742 2 20 0 0 16
OI Put 13770 36230 25936 29930 18480 13080 6558 4720 508 60 12 0 0 0 0 0 0 0 0 0 8
IV 92,332 85,594 79,33 73,61 68,482 63,972 60,09 56,831 54,18 52,11 50,593 49,598 49,094 49,049 49,43 50,203 51,326 52,761 54,467 56,407 58,544


Опционы на Сбербанк, октябрь
Волатильность
128
120
112
104
96
88
80
72
64
56
48
40
1800
1500
1200
900
600
300
0
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 40 114 178 356 1536 564 2410 1300 1176 32 126 22
OI Put 34 42 68 478 40 280 338 218 1038 144 1094 1154 1822 368 1244 142 104 6 2 2
IV 132,71 107,59 98,773 90,134 81,904 74,28 67,433 61,504 56,609 52,844 50,292 49,02 49,045 50,261 52,38 55,05 58,041 61,273 64,736 68,426


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 94 126 368
OI Put 0 0 0 0 100 0 0 8 162 334 172 44 40
IV 73,945 68,01 62,391 57,165 52,4 48,153 44,469 41,388 38,941 37,151 36,032 35,585 35,793


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 94 126 368 48 172 0 0 0 0
OI Put 0 0 0 0 0 100 0 0 8 162 334 172 44 40 0 0 0 0 0 0
IV 80,083 73,928 67,998 62,38 57,153 52,385 48,132 44,442 41,353 38,896 37,095 35,963 35,501 35,692 36,492 37,826 39,594 41,687 44,006 46,473


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
90,2%
другие
0,9%
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
727 526
102 438
140 318
383 924
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