

Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 02.06.2008



■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2453,7	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,71	-0,18%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,87	0,24%
EURO/USD	1,5508	-0,12%

■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	244 590	-0,55%	306 611	6,85%	249 352	-1,20%
LKOH	26 180	-1,76%	63 813	-27,84%	162 534	-6,24%
GAZR	35 626	-1,14%	63 410	-16,43%	254 628	-0,50%
SBER	8 500	-0,64%	56 227	-4,79%	702 872	4,16%
VTB	9 583	-1,64%	25 887	27,46%	267 988	-0,87%
URSI	1 260	-1,56%	12 316	336,43%	106 114	-5,67%
GMKR	69 750	0,11%	9 037	7,02%	21 516	2,69%
ROSN	28 901	0,73%	8 793	-1,40%	61 070	2,18%
SNGR	28 764	-0,81%	6 581	-31,31%	89 986	-0,44%
PLZL	16 582	12,04%	1 140	162,07%	12 914	-0,88%
SBPR	5 340	-0,95%	211	6,57%	4 710	0,38%
MTSI	29 810	-1,86%	208	69,11%	3 068	-0,13%
TRNF	36 000	0,00%	159	103,85%	1 802	-9,26%
NVTK	20 805	-0,45%	147	72,94%	96	-9,43%
RTSo	333	-0,37%	47	-83,39%	54 202	0,00%
RTKM	26 971	-0,53%	11	175,00%	756	-0,53%
RTSc	0	--	0	--	56	0,00%

Деривативы на акции и индексы: основные новости

[11:31] Канадская Archangel Diamond и "ЛУКОЙЛ" договорились о продлении срока выкупа акций "Архангельскгеолодобычи" до конца года. /ПРАЙМ-ТАСС/

[12:03] "Газпром" построит разведочные скважины на Долгинском нефтяном месторождении на шельфе Печорского моря. /ПРАЙМ-ТАСС/

[12:27] Члены правления "Газпрома" А.Круглов и К.Селезнев вышли из состава акционеров компании. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:14] Менеджмент РАО "ЕЭС " ведет переговоры со Сбербанком о возможности его использования в качестве депозитария для физлиц. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:35] "Газпром" в течение 5-ти лет планирует увеличить присутствие на энергетическом рынке Великобритании до 10-15 проц. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:52] Экспорт нефти по системе АК "Транснефть" в мае сократился на 2,5 проц и составил 18,845 млн т - ЦДУ-ТЭК. /ПРАЙМ-ТАСС/

[16:29] "Газпром" объявил открытый конкурс на предоставление банковских гарантий на 42 месяца. /ПРАЙМ-ТАСС/

■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	13 июн	36,87	0,24%	0	--	0	--
USD/RUR / PTC	16 июн	23 735,00	0,02%	4 501	-85,65%	364 936	0,20%

**■ Фьючерсы на акции и индексы:
краткие комментарии по итогам торгов**

Несмотря на позитивное закрытие американских индексов накануне, а также позитивное завершение торговой сессии на азиатских рынках, европейские индексы демонстрировали снижение в течение рабочего дня на 1% - 1,5%. Российский фондовый рынок последовал вслед за Европой, в итоге большинство ликвидных бумаг провели день в отрицательной зоне. Данные по статистике США, вышедшей уже после закрытия российских бирж в 18-00 оказались положительными. Индекс производственной активности в США (ISM Manufacturing) в мае увеличился до 49,6 пункта с 48,6 пункта месяцем ранее, в то время как эксперты ожидали уменьшения показателя до 48,5 пункта.

Индекс РТС просел сегодня на 0,29% и составил 2452,76 пункта. Фьючерс на индекс РТС просел на 0,55%, и стоит теперь 2445,9 пункта по шкале индекса.

На срочном рынке необычным образом вел себя фьючерс на акции Полюсзолота, который показал значимый рост на фоне внутренних новостей. Как стало известно, компания Onexim Holdings Limited, представляющая интересы Михаила Прохорова, сделала официальное предложение Полюс Золото о выкупе 6,54% акций компаний, принадлежащих Jenington International. Эти новости подогревают спекулятивный интерес к контракту, в итоге рост составил 12,04%. В плюсе удалось удержаться фьючерсам на акции Роснефти и Норникеля, которые завершили день с ростом на 0,73% и 0,11%.

Рынок индексных деривативов и деривативов на акции: итоги торгов

Фьючерсы (июньские): *

Код БА	Исп-е	Цена	Изм-е	Low	High	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е	Базис (на 1 ед. БА)	Изм-е	Доход-ть СПОТ-Ф ^А
GMKR	16 июн	69 750	0,11%	69 202	71 175	9 037	7,02%	21 516	2,69%	13,99	208,20%	4,66%
GAZR	16 июн	35 626	-1,14%	35 513	36 065	63 410	-16,43%	254 628	-0,50%	0,26	-10,34%	1,70%
LKOH	16 июн	26 180	-1,76%	26 000	26 690	63 813	-27,84%	162 534	-6,24%	2,21	-56,67%	1,97%
MTSI	16 июн	29 810	-1,86%	29 701	30 475	208	69,11%	3 068	-0,13%	-1,86	-18500,00%	-14,07%
NVTK	16 июн	20 805	-0,45%	20 605	21 325	147	72,94%	96	-9,43%	-2,45	-21,89%	-26,43%
PLZL	16 июн	16 582	12,04%	14 999	16 747	1 140	162,07%	12 914	-0,88%	6,20	162,06%	8,14%
RTSc	16 июн	0	--	0	0	0	--	56	0,00%	--	--	--
RTSI	16 июн	244 590	-0,55%	242 950	246 700	306 611	6,85%	249 352	-1,20%	-7,80	-1713,95%	-8,00%
ROSN	16 июн	28 901	0,73%	28 501	29 183	8 793	-1,40%	61 070	2,18%	0,21	2000,00%	1,69%
RTSo	16 июн	333	-0,37%	333	333	47	-83,39%	54 202	0,00%	1,70	2933,33%	2,93%
RTKM	16 июн	26 971	-0,53%	26 500	27 150	11	175,00%	756	-0,53%	-1,83	-140,79%	-15,29%
SNGR	16 июн	28 764	-0,81%	28 574	29 780	6 581	-31,31%	89 986	-0,44%	0,04	137,11%	2,92%
SBPR	16 июн	5 340	-0,95%	5 326	5 395	211	6,57%	4 710	0,38%	0,30	850,00%	12,80%
SBER	16 июн	8 500	-0,64%	8 406	8 550	56 227	-4,79%	702 872	4,16%	0,40	14,29%	11,00%
TRNF	16 июн	36 000	0,00%	35 805	36 128	159	103,85%	1 802	-9,26%	0,00	100,00%	0,00%
URSI	16 июн	1 260	-1,56%	1 252	1 270	12 316	336,43%	106 114	-5,67%	0,00	-93,75%	1,80%
VTB	16 июн	9 583	-1,64%	9 554	9 775	25 887	27,46%	267 988	-0,87%	0,00	-153,85%	-1,70%
GMKR	15 сен	70 500	-0,01%	70 002	71 897	167	-53,35%	178	0,00%	88,99	26,46%	3,96%
GAZR	15 сен	36 097	-1,26%	36 025	36 670	860	1729,79%	2 304	121,54%	4,97	-9,47%	4,24%
LKOH	15 сен	26 580	-1,19%	26 326	26 944	1 309	-18,24%	5 000	38,35%	42,21	40,23%	4,90%
MTSI	15 сен	0	--	0	0	0	--	148	0,00%	--	--	--
NVTK	15 сен	20 148	-1,69%	20 148	20 148	5	400,00%	10	--	-9,02	-48,60%	-12,98%
PLZL	15 сен	16 589	11,51%	15 700	16 589	28	1300,00%	268	8,06%	6,90	401,31%	1,26%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	246 410	-0,76%	245 000	248 430	3 538	-39,89%	14 826	10,13%	10,40	-55,02%	1,42%
ROSN	15 сен	29 299	1,43%	28 552	29 300	1 886	1950,00%	1 356	205,41%	4,19	113,78%	4,50%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	4	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	0	--	0	0	0	--	8	0,00%	--	--	--
SBER	15 сен	87 300	--	87 300	87 300	10	--	112	9,80%	2,70	103,17%	9,87%
SNGR	15 сен	29 740	0,78%	29 211	29 740	14	-98,66%	4 234	0,47%	1,01	144,44%	10,89%
SBER	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
TRNF	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	96	0,00%	--	--	--
URSI	15 сен	1 300	-0,38%	1 271	1 327	165	55,66%	966	48,16%	0,04	0,00%	9,80%
VTB	15 сен	9 790	-1,15%	9 770	9 901	12 086	8852,59%	25 930	1342,16%	0,00	14,94%	6,46%

* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Опционы (июньские):

БА	Объем/изменение				Открытых позиций/изменение				Put/Call Ratio	HV 10 Days
	Call		Put		Call		Put			
GAZR-мм.гг	15 322	-79%	4 124	-94%	581 288	0%	1 391 724	0%	0,27	14,77%
GMKR-мм.гг	1 794	-29%	832	2769%	162 884	0%	141 462	0%	0,46	21,03%
LKOH-мм.гг	60	-50%	389	-79%	247 058	0%	482 126	0%	6,48	22,11%
ROSN-мм.гг	0	--	0	--	13 892	0%	7 124	0%	--	14,01%

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	188 826	28 000	934	5 050		7 600
30		26	266 282	32 000	159 530	2 002		3 675
48		11	156 068	33 000	149 778	2 028		2 770
325		1 527	25 302	35 000	47 586	1 031		975
762		1 009	88 542	36 000	67 656	1 110		470
				38 000	9 958	1 218		50

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
5		10	34 248	20 000	48 476	0		0
15		283	68 076	21 000	94 468	32		5 430
10		10	40 218	22 000	46 408	0		0
8		9	28 836	23 000	30 858	16		3 100
				24 000	4 610	9		2 390
				25 000	7 496	3		1 490

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
700		8	10 318	67 500	3 506	0		0
1 506		73	656	70 000	12 186	550		1 325
0		0	312	72 500	4 118	93		600
0		0	272	75 000	34 126	995		220
0		0	48	77 500	12 128	56		105
				80 000	33 948	100		60

ROSN-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	66	20 000	6	0		0
0		0	54	21 000	18	0		0
0		0	6 980	22 000	6 210	0		0
0		0	4	23 000	5 442	0		0
0		0	20	24 000	2 216	0		0

■ Рынок валютных деривативов: итоги торгов

■ Фьючерсы на Доллар/Рубль *

Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Low	High	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е	Базис (на 1 ед. БА)	Изм-е
РТС	16 июн	23 735,00	0,02%	23 700,00	23 765,00	4 501	-85,65%	364 936	0,20%	0,023	190,00%
РТС	15 сен	23 825,00	0,04%	23 793,00	23 825,00	183	-86,00%	200 122	0,17%	0,113	87,50%

* По всем биржам, кроме ММВБ, объем открытых позиций удвоенный

■ Фьючерсы на Евро/Рубль

Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Low	High	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е	Базис (на 1 ед. БА)	Изм-е
СПВБ	13 июн	36,87	0,24%	0,00	0,00	0	--	0	--	0,001	--