

Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 03.06.2008



■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2429,47	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,67	-0,17%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,88	0,04%
EURO/USD	1,5455	-0,34%

■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	242 950	-0,67%	288 848	-5,79%	241 272	-3,24%
LKOH	26 030	-0,57%	80 983	26,91%	167 420	3,01%
GAZR	35 428	-0,56%	69 800	10,08%	250 316	-1,69%
SBER	8 421	-0,93%	55 851	-0,67%	708 724	0,83%
URSI	1 335	5,95%	38 425	211,99%	99 964	-5,80%
VTB	9 511	-0,75%	20 222	-21,88%	265 522	-0,92%
GMKR	68 350	-2,01%	14 947	65,40%	17 192	-20,10%
ROSN	28 510	-1,35%	14 854	68,93%	58 048	-4,95%
SNGR	28 634	-0,45%	5 838	-11,29%	88 382	-1,78%
PLZL	16 230	-2,12%	1 558	36,67%	13 206	2,26%
RTSo	331	-0,60%	933	1885,11%	54 276	0,14%
MTSI	30 149	1,14%	241	15,87%	3 070	0,07%
TRNF	36 483	1,34%	151	-5,03%	1 692	-6,10%
RTKM	27 015	0,16%	96	772,73%	654	-13,49%
SBPR	5 254	-1,61%	59	-72,04%	4 688	-0,47%
NYTK	20 840	0,17%	10	-93,20%	96	0,00%
RTSc	347	--	3	--	50	-10,71%

Деривативы на акции и индексы: основные новости

[11:22] Электростанции ПАО "ЕЭС России" за январь-май 2008 г увеличили выработку электроэнергии на 5,5 проц до 319,6 млрд кВт-ч. /ПРАЙМ-ТАСС/

[12:21] А.Чубайс обвиняет "Роснефть" в "антигосударственной позиции" по ТГК-11. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:06] "Газпром" и Туркмения полностью удовлетворены итогами работы на базе долгосрочного контракта на закупку газа в этой стране. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:23] "Газпром" приступил к мероприятиям по доразведке Чаядинского нефтегазоконденсатного месторождения. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:33] "Газпром" планирует в 2016 г обеспечить ввод Чаядинского месторождения и газопровода "Якутия - Хабаровск - Владивосток". /ПРАЙМ-ТАСС/

[18:15] ПАО "ЕЭС" сократило свою долю в уставном капитале ТГК-11 с 50,467 до 21,994 проц. /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	0,00%	0	--	0	--
USD/RUR / PTC	16 июн	23 800,00	0,27%	10 497	133,21%	362 282	-0,73%

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

Торги на российском рынке проходили в рамках понижающей тенденции. Торговая сессия на западных площадках проходила весьма спокойно. Американские индексы демонстрировали рост, в результате выхода позитивной макростатистики по заказам предприятий, которые в апреле выросли на 1,1%, тогда как ожидалось снижение на 0,1%. Однако сдерживающим обстоятельством стало выступление главы ФРС, в котором было сказано, что текущий уровень ставок в США является оптимальным, а значит ждать снижения основной процентной ставки не приходится. Европейские рынки также выглядели позитивно, прибавив в течение дня в среднем 0,2-0,4%.

Индекс РТС снизился на 0,95%, составив на конец дня 23429,47 пункта. Фьючерс на индекс РТС на 0,67% и стоит теперь 2429,5 пункта по шкале индекса.

На срочном рынке вновь наблюдается разнонаправленное движение. Сегодня в секторе телекомов наблюдался рост. Существенный рост котировок наблюдался во фьючерсе на акции Уралсвязьинформа, который прибавил 5,95%. Также на зеленой территории завершили день фьючерсы на акции Ростелекома и МТС, которые прибавили 0,16% и 1,14%. Банковский сектор находился в минусе, по итогам дня фьючерсы на акции Сбербанка и ВТБ потеряли 0,93% и 0,75%.

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	Дох-ть СПОТ-Ф ^А
GMKR	16 июн	68 350	-2,01%	67 708	69 840	14 947	65,40%	17 192	-20,10%	0,00	-100,00%	0,00%
GAZR	16 июн	35 428	-0,56%	35 201	35 714	69 800	10,08%	250 316	-1,69%	0,16	-38,46%	1,13%
LKOH	16 июн	26 030	-0,57%	25 160	26 392	80 983	26,91%	167 420	3,01%	3,00	35,75%	2,89%
MTSI	16 июн	30 149	1,14%	29 450	30 489	241	15,87%	3 070	0,07%	-0,39	79,03%	-3,16%
NVTK	16 июн	20 840	0,17%	20 840	20 840	10	-93,20%	96	0,00%	2,12	186,53%	25,06%
PLZL	16 июн	16 230	-2,12%	15 881	16 994	1 558	36,67%	13 206	2,26%	8,00	29,03%	12,09%
RTSc	16 июн	347	--	347	347	3	--	50	-10,71%	2,68	100,77%	4,77%
RTSI	16 июн	242 950	-0,67%	242 500	245 150	288 848	-5,79%	241 272	-3,24%	0,03	100,38%	0,03%
ROSN	16 июн	28 510	-1,35%	28 400	28 900	14 854	68,93%	58 048	-4,95%	0,27	28,57%	2,38%
RTSo	16 июн	331	-0,60%	330	332	933	1885,11%	54 276	0,14%	2,09	22,94%	3,91%
RTKM	16 июн	27 015	0,16%	26 755	27 060	96	772,73%	654	-13,49%	0,27	114,75%	2,44%
SNGR	16 июн	28 634	-0,45%	28 422	28 950	5 838	-11,29%	88 382	-1,78%	-0,08	-311,11%	-6,64%
SBPR	16 июн	5 254	-1,61%	5 202	5 280	59	-72,04%	4 688	-0,47%	-0,01	-103,33%	-0,46%
SBER	16 июн	8 421	-0,93%	8 311	8 512	55 851	-0,67%	708 724	0,83%	0,32	-20,00%	9,56%
TRNF	16 июн	36 483	1,34%	35 617	36 581	151	-5,03%	1 692	-6,10%	215,00	--	14,47%
URSI	16 июн	1 335	5,95%	1 225	1 339	38 425	211,99%	99 964	-5,80%	0,00	-300,00%	-3,65%
VTB	16 июн	9 511	-0,75%	9 390	9 634	20 222	-21,88%	265 522	-0,92%	0,00	400,00%	5,55%
GMKR	15 сен	68 850	-2,34%	68 850	70 500	332	98,80%	424	138,20%	50,00	-43,81%	2,29%
GAZR	15 сен	35 951	-0,40%	35 661	36 052	4 404	412,09%	9 386	307,38%	5,39	8,45%	4,67%
LKOH	15 сен	26 400	-0,68%	26 299	26 700	393	-69,98%	5 120	2,40%	40,00	-5,24%	4,72%
MTSI	15 сен	30 100	--	30 100	30 500	2	--	152	2,70%	-0,88	99,71%	-0,89%
NVTK	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	10	0,00%	--	--	--
PLZL	15 сен	16 011	-3,48%	16 011	16 011	1	-96,43%	268	0,00%	-13,90	-301,45%	-2,62%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	244 695	-0,70%	244 305	246 665	3 686	4,18%	16 368	10,40%	17,48	68,08%	2,44%
ROSN	15 сен	28 850	-1,53%	28 102	29 179	980	-48,04%	1 472	8,55%	3,67	-12,41%	4,03%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	4	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	27 205	--	27 080	27 205	2	--	8	0,00%	2,17	100,80%	2,45%
SBER	15 сен	84 291	-3,45%	84 291	86 950	4	-60,00%	112	0,00%	0,40	-85,15%	1,49%
SNGR	15 сен	29 150	-1,98%	29 100	29 439	4 284	30500,00%	12 560	196,65%	0,44	-56,52%	4,79%
SBER	15 сен	5 437	--	5 307	5 449	7	--	12	20,00%	-29,52	65,11%	-112,02%
TRNF	15 сен	37 050	--	37 050	38 990	18	--	96	0,00%	782,00	102,17%	6,56%
URSI	15 сен	1 364	4,92%	1 265	1 364	180	9,09%	1 072	10,97%	0,03	-34,15%	6,14%
VTB	15 сен	9 698	-0,94%	9 580	9 710	4 469	-63,02%	34 806	34,23%	0,00	4,00%	6,85%

* 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	5 439	-65%	13 796	235%	582 590	0%	1 408 806	1%	2,54	13,24%
GMKR-мм.гг	1 293	-28%	4 567	449%	163 950	1%	141 396	0%	3,53	20,09%
LKOH-мм.гг	13	-78%	113	-71%	246 786	0%	482 074	0%	8,69	20,42%
ROSN-мм.гг	0	--	0	--	13 892	0%	7 124	0%	--	13,82%

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
80		82	156 026	33 000	150 242	289		2 400
100		7 624	59 308	34 000	77 332	505		1 480
350		694	25 658	35 000	47 444	649		800
825		2 328	88 950	36 000	67 386	551		260
				37 000	12 740	1 414		90
				38 000	10 226	1 977		20

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	147 918	19 000	8 298	0		0
5		8	34 232	20 000	48 300	0		0
6		1	68 074	21 000	94 468	0		0
10		92	40 208	22 000	46 408	1		4 221
0		0	28 836	23 000	30 858	0		0
				25 000	7 500	12		1 410

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
950		36	10 328	67 500	3 414	52		2 000
2 461		34	660	70 000	13 344	1 177		550
0		0	312	72 500	4 114	12		180
0		0	272	75 000	34 126	0		0
				80 000	33 948	50		45
				82 500	42	2		44

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	23 800,00	0,27%	23 643,00	23 805,00	10 497	133,21%	362 282	-0,73%	0,129	471,11%
РТС	15 сен	23 870,00	0,19%	23 740,00	23 870,00	4 502	2360,11%	198 186	-0,97%	0,199	76,44%

* 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	0,00%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,012	-1133,33%