

Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 06.06.2008



■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2377,91	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,69	-0,64%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,93	0,43%
EURO/USD	1,5739	0,03%

■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	238 365	0,83%	337 715	-7,82%	198 984	-9,73%
SBER	8 136	-1,79%	148 296	18,27%	791 430	6,18%
GAZR	34 580	1,44%	84 629	-30,45%	228 974	-3,34%
LKOH	24 929	1,51%	79 495	-28,70%	189 528	-4,30%
VTB	8 920	-3,47%	43 515	46,44%	260 348	-1,73%
ROSN	28 270	3,18%	11 633	-26,46%	45 268	3,30%
URSI	1 293	-1,75%	9 142	23,39%	119 608	-2,51%
SNGR	28 200	1,19%	9 138	5,48%	78 772	-11,06%
GMKR	66 325	-0,60%	6 452	-11,17%	24 742	-1,41%
RTSo	333	5,81%	2 828	-24,51%	51 162	-5,55%
PLZL	15 100	0,01%	250	-82,66%	13 200	0,64%
TRNF	35 733	-0,05%	231	381,25%	1 606	-0,86%
SBPR	5 197	-0,35%	112	-74,66%	3 990	2,68%
MTSI	29 551	-0,57%	58	-27,50%	3 052	-0,26%
RTKM	27 730	3,74%	39	3800,00%	650	0,31%
NVTK	20 602	1,84%	1	-98,04%	202	0,00%
RTSc	0	-100,00%	0	-100,00%	14	0,00%

■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	13 июн	36,92	0,41%	0	--	0	--
USD/RUR / РТС	16 июн	23 630,00	-0,41%	25 225	11,75%	280 490	-13,33%

Деривативы на акции и индексы: основные новости

[10:32] Отрицательный результат Группы ВТБ по операциям с ценными бумагами в 1 квартале может превысить 400 млн долл. /ПРАЙМ-ТАСС/
[13:03] Чистая прибыль Сбербанка за январь-апрель составила около 56,4 млрд руб. /ПРАЙМ-ТАСС/
[17:47] Торги акциями "РАО "ЕЭС России" прекратились на российских биржах в 17:45 мск. /ПРАЙМ-ТАСС/
[17:49] ММВБ завершила торги акциями РАО "ЕЭС" в связи с закрытием реестра акционеров энергохолдинга и предстоящей реорганизацией. /ПРАЙМ-ТАСС/

Валютные деривативы: основные новости

[16:34] Число новых рабочих мест вне с/х секторе США в мае сократилось на 49 тыс. /МФД-ИнфоЦентр/
[16:36] Уровень безработицы в США в мае вырос до 5.5% с 5.0% в апреле. /МФД-ИнфоЦентр/
[16:55] Средняя продолжительность рабочей недели в США в мае не изменилась и составила 33.7 часов, в соответствии с прогнозами аналитиков. /МФД-ИнфоЦентр/

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

С сильного гэпа вверх начались торги на отечественном рынке. Благоприятная конъюнктура на внешних рынках, послужила поводом позитивного открытия торгов. В течение торговой сессии, поддержку российскому рынку оказывали растущие быстрыми темпами цены на нефть, а также позитивная динамика на зарубежных площадках. Сегодня в 16.30 вышли данные по безработице и числу вновь созданных рабочих мест, число рабочих мест в экономике США в мае снизилось по итогам пятого месяца подряд, падение составило 49 тыс. Такие данные негативно сказались на динамике торгов.

Индекс РТС прибавил сегодня 1,11%, и составил 2377,91 пункта. Фьючерс на индекс РТС выглядел скромнее и вырос на 0,83% и стоит теперь 2383,65 пункта по шкале индекса.

Срочный рынок выглядел закрылся разнонаправлено. Рост фьючерсов на акции Лукойла и Газпрома составил 1,51% и 1,44%. Фьючерсы на акции Роснефти и Сургутнефтегаза прибавили 3,18% и 1,19%. А вот банковский сектор торговался преимущественно на отрицательной территории. Сегодня были опубликованы негативные новости по списаниям ВТБ от операций с ценными бумагами в размере 450 млн. долл. Эти данные отразились на динамике торгов фьючерсом на акции ВТБ, который потерял в итоге 3,47%.

■ 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	66 325	-0,60%	66 155	68 320	6 452	-11,17%	24 742	-1,41%	17,49	-99,74%	8,61%
GAZR	16 июн	34 580	1,44%	34 061	34 999	84 629	-30,45%	228 974	-3,34%	0,50	-99,85%	4,72%
LKOH	16 июн	24 929	1,51%	24 450	25 249	79 495	-28,70%	189 528	-4,30%	4,90	-99,80%	6,42%
MTSI	16 июн	29 551	-0,57%	29 551	30 227	58	-27,50%	3 052	-0,26%	-2,49	-100,84%	-26,55%
NVTK	16 июн	20 602	1,84%	20 602	20 602	1	-98,04%	202	0,00%	0,90	-99,56%	13,92%
PLZL	16 июн	15 100	0,01%	15 050	15 579	250	-82,66%	13 200	0,64%	5,00	-99,67%	10,54%
RTSc	16 июн	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	14	0,00%	--	--	--
RTSI	16 июн	238 365	0,83%	235 700	241 785	337 715	-7,82%	198 984	-9,73%	5,74	-99,76%	8,51%
ROSN	16 июн	28 270	3,18%	27 500	28 545	11 633	-26,46%	45 268	3,30%	0,67	-99,76%	7,74%
RTSo	16 июн	333	5,81%	321	333	2 828	-24,51%	51 162	-5,55%	11,27	-96,42%	27,84%
RTKM	16 июн	27 730	3,74%	26 700	27 950	39	3800,00%	650	0,31%	-0,44	-100,16%	-5,03%
SNGR	16 июн	28 200	1,19%	27 847	28 645	9 138	5,48%	78 772	-11,06%	-0,08	-100,29%	-9,22%
SBPR	16 июн	5 197	-0,35%	5 047	5 276	112	-74,66%	3 990	2,68%	0,49	-99,06%	30,17%
SBER	16 июн	8 136	-1,79%	8 045	8 374	148 296	18,27%	791 430	6,18%	0,36	-99,57%	14,48%
TRNF	16 июн	35 733	-0,05%	35 005	36 242	231	381,25%	1 606	-0,86%	33,00	-99,91%	2,93%
URSI	16 июн	1 293	-1,75%	1 292	1 344	9 142	23,39%	119 608	-2,51%	0,00	-100,00%	0,00%
VTB	16 июн	8 920	-3,47%	8 911	9 354	43 515	46,44%	260 348	-1,73%	0,00	-100,00%	0,00%
GMKR	15 сен	67 000	-1,03%	67 000	68 599	1 019	343,04%	2 638	280,12%	84,99	-98,74%	4,14%
GAZR	15 сен	34 979	1,61%	34 599	35 348	5 790	-64,14%	61 856	12,39%	4,49	-98,70%	4,19%
LKOH	15 сен	25 121	0,49%	25 000	25 551	4 148	281,25%	15 744	53,60%	24,10	-99,04%	3,12%
MTSI	15 сен	30 303	--	30 200	31 410	5	--	164	1,23%	5,03	--	5,29%
NVTK	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
PLZL	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	256	0,00%	--	--	--
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	239 100	0,67%	237 325	242 945	35 228	93,67%	55 484	46,65%	13,09	-99,45%	1,92%
ROSN	15 сен	28 600	3,25%	28 293	28 745	709	94,78%	2 900	19,64%	3,97	-98,57%	4,54%
RTSo	15 сен	328	--	325	328	141	--	2	-50,00%	5,92	--	1,43%
RTKM	15 сен	28 500	--	28 500	28 500	5	--	18	125,00%	7,26	--	8,19%
SBER	15 сен	84 792	-0,24%	84 792	85 268	20	11,11%	116	0,00%	3,79	-95,54%	15,07%
SNGR	15 сен	28 488	0,53%	28 300	29 179	3 935	1949,48%	34 912	130,66%	0,21	-99,27%	2,37%
SBER	15 сен	5 252	--	5 150	5 252	85	--	62	416,67%	-28,48	--	-115,80%
TRNF	15 сен	36 847	1,37%	36 460	36 847	49	63,33%	262	52,33%	1147,00	-96,84%	10,05%
URSI	15 сен	1 345	-3,58%	1 340	1 438	400	250,88%	1 684	16,94%	0,05	-96,27%	12,50%
VTB	15 сен	9 080	-3,39%	9 080	9 500	12 733	245,63%	59 064	33,10%	0,00	-98,30%	5,78%

* 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	2 374	-89%	6 264	-70%	549 356	0%	1 379 178	0%	2,64	16,19%
GMKR-мм.гг	96	-58%	140	69%	165 020	0%	141 098	0%	1,46	18,47%
LKOH-мм.гг	4 183	-7%	128	-93%	294 452	-2%	498 844	0%	0,03	25,36%
ROSN-мм.гг	0	--	0	--	13 848	0%	22 324	0%	--	19,79%

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
3		2 271	88 848	30 000	23 148	92		4 600
155		765	157 700	33 000	149 620	23		1 481
750		341	24 494	35 000	45 138	964		180
1 600		252	59 662	36 000	38 028	783		45
				37 000	12 532	446		10
				38 000	8 892	51		10

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
2		12	16 926	18 000	1 738	1		6 900
2		53	84 350	21 000	93 684	1		3 900
10		6	40 462	22 000	46 346	1		3 050
5		57	28 696	23 000	30 820	307		1 820
				24 000	5 554	294		896
				25 000	55 716	3 579		290

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	5 656	62 500	116	0		0
342		23	3 980	65 000	2 606	2		2 500
1 800		44	10 312	67 500	3 234	56		518
0		0	654	70 000	14 648	21		281
0		0	312	72 500	4 104	5		40
7 923		2	276	75 000	34 110	12		1

ROSN-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	54	21 000	0	0		0
0		0	6 980	22 000	6 208	0		0
0		0	15 204	23 000	5 424	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	23 630,00	-0,41%	23 622,00	23 730,00	25 225	11,75%	280 490	-13,33%	-0,057	49,11%
РТС	15 сен	23 720,00	-0,42%	23 700,00	23 800,00	38 682	668,57%	236 250	19,94%	0,033	265,00%

* 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	36,92	0,41%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,010	-300,00%