

# Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 30.05.2008



## ■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2459,88	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,76	0,32%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,78	-0,33%
EURO/USD	1,5527	0,02%

## ■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	245 945	0,97%	286 958	-19,75%	252 382	-1,85%
LKOH	26 650	0,95%	88 434	-48,81%	173 342	3,13%
GAZR	36 038	-0,34%	75 881	-29,90%	255 918	-1,60%
SBER	8 555	0,41%	59 057	-19,56%	674 814	-1,88%
VTB	9 743	0,35%	20 310	-13,31%	270 332	-1,64%
SNGR	29 000	3,35%	9 581	4,56%	90 388	-0,93%
ROSN	28 691	1,40%	8 918	-41,80%	59 766	3,40%
GMKR	69 671	1,27%	8 444	-52,15%	20 952	-12,64%
URSI	1 280	-0,16%	2 822	-78,82%	112 492	0,27%
PLZL	14 800	0,01%	435	-15,20%	13 028	-10,74%
RTSo	334	1,20%	283	74,69%	54 202	-0,15%
SBPR	5 391	1,30%	198	-69,95%	4 692	-0,64%
MTSI	30 374	1,09%	123	-58,02%	3 072	-5,82%
NVTK	20 900	1,46%	85	37,10%	106	-52,25%
TRNF	36 000	2,89%	78	-26,42%	1 986	-2,07%
RTKM	27 114	0,97%	4	33,33%	760	0,53%
RTSc	0 --		0 --		56	0,00%

## ■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	13 июн	36,78	-0,30%	0	--	0	--
USD/RUR / PTC	16 июн	23 730,00	0,06%	31 371	51,45%	364 200	4,35%

## Деривативы на акции и индексы: основные новости

[12:41] Д.Медведев поручил Минэнерго РФ заменить ПАО "ЕЭС России" так, "чтобы потребители этого не почувствовали. /ПРАЙМ-ТАСС/

[13:59] Потребители Ярославской области не имеют задолженности перед "Газпромом" и оплачивают поставки природного газа авансом. /ПРАЙМ-ТАСС/

[14:57] "ЛУКОЙЛ" опубликует отчет за 1-й квартал 2008 г по US GAAP 4 июня. /ПРАЙМ-ТАСС/

[16:02] "ЛУКОЙЛ" потратил 15,3 млрд руб в 2007 г на мероприятия по обеспечению экологической безопасности. /ПРАЙМ-ТАСС/

## ■ 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 <sup>А</sup>
GMKR	16 июн	69 671	1,27%	68 530	70 030	8 444	-52,15%	20 952	-12,64%	-12,93	-59,63%	-3,55%
GAZR	16 июн	36 038	-0,34%	35 682	36 380	75 881	-29,90%	255 918	-1,60%	0,29	-52,46%	1,54%
LKOH	16 июн	26 650	0,95%	26 035	26 685	88 434	-48,81%	173 342	3,13%	5,10	355,00%	3,67%
MTSI	16 июн	30 374	1,09%	30 100	30 440	123	-58,02%	3 072	-5,82%	-0,01	98,11%	-0,06%
NVTK	16 июн	20 900	1,46%	20 820	20 900	85	37,10%	106	-52,25%	-2,01	-234,90%	-17,81%
PLZL	16 июн	14 800	0,01%	14 761	14 965	435	-15,20%	13 028	-10,74%	-9,99	-699,20%	-12,53%
RTSc	16 июн	0	--	0	0	0	--	56	0,00%	--	--	--
RTSI	16 июн	245 945	0,97%	242 335	246 755	286 958	-19,75%	252 382	-1,85%	-0,43	86,69%	-0,36%
ROSN	16 июн	28 691	1,40%	27 905	28 746	8 918	-41,80%	59 766	3,40%	0,01	-98,44%	0,07%
RTSo	16 июн	334	1,20%	327	334	283	74,69%	54 202	-0,15%	-0,06	-108,22%	-0,08%
RTKM	16 июн	27 114	0,97%	27 114	27 300	4	33,33%	760	0,53%	-0,76	-590,91%	-5,22%
SNGR	16 июн	29 000	3,35%	27 611	29 228	9 581	4,56%	90 388	-0,93%	-0,10	-61,67%	-6,39%
SBPR	16 июн	5 391	1,30%	5 370	5 440	198	-69,95%	4 692	-0,64%	-0,04	81,82%	-1,38%
SBER	16 июн	8 555	0,41%	8 500	8 625	59 057	-19,56%	674 814	-1,88%	0,35	133,33%	7,87%
TRNF	16 июн	36 000	2,89%	35 019	36 850	78	-26,42%	1 986	-2,07%	-489,99	-4799,90%	-25,11%
URSI	16 июн	1 280	-0,16%	1 265	1 284	2 822	-78,82%	112 492	0,27%	0,02	-5,88%	23,59%
VTB	16 июн	9 743	0,35%	9 620	9 843	20 310	-13,31%	270 332	-1,64%	0,00	-31,58%	2,56%
GMKR	15 сен	70 504	0,01%	70 001	71 680	358	817,95%	178	9,88%	70,37	-56,53%	3,04%
GAZR	15 сен	36 558	0,05%	36 415	36 800	47	-24,19%	1 040	5,69%	5,49	24,77%	4,50%
LKOH	15 сен	26 900	0,84%	26 492	26 900	1 601	913,29%	3 614	75,95%	30,10	17,58%	3,34%
MTSI	15 сен	0	--	0	0	0	--	148	0,00%	--	--	--
NVTK	15 сен	20 494	--	20 494	20 494	1	--	0	-100,00%	-6,07	97,03%	-8,49%
PLZL	15 сен	14 877	--	14 840	14 877	2	--	248	0,00%	-2,29	99,85%	-0,45%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	248 300	1,02%	241 250	248 600	5 886	-40,97%	13 462	10,94%	23,12	21,88%	3,07%
ROSN	15 сен	28 886	2,25%	28 200	28 886	92	-6,12%	444	26,86%	1,96	880,00%	2,06%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	4	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	0	--	0	0	0	--	8	0,00%	--	--	--
SBER	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	102	0,00%	--	--	--
SNGR	15 сен	29 511	3,91%	28 850	29 511	1 045	2448,78%	4 214	93,66%	0,41	47,86%	4,29%
SBER	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
TRNF	15 сен	37 036	--	37 036	37 036	1	--	96	-2,04%	546,01	101,56%	4,39%
URSI	15 сен	1 305	-0,15%	1 305	1 315	106	53,62%	652	48,18%	0,04	-2,38%	9,49%
VTB	15 сен	9 904	1,04%	9 900	10 000	135	-65,99%	1 798	15,70%	0,00	55,36%	5,39%

\* 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	73 562	486%	65 974	699%	580 582	-1%	1 389 426	0%	0,90	22,25%
GMKR-мм.гг	2 513	-41%	29	-93%	162 918	0%	141 520	0%	0,01	34,45%
LKOH-мм.гг	121	-58%	1 864	394%	247 064	0%	482 748	0%	15,40	29,20%
ROSN-мм.гг	0	--	0	--	13 892	0%	7 124	0%	--	25,91%

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
14		14	57 552	29 000	6 452	2 940		7 100
12		108	88 852	30 000	23 186	1 031		6 300
60		2	79 714	31 000	13 424	3 200		5 200
330		30 589	22 876	35 000	46 996	30 987		1 480
650		33 072	88 604	36 000	67 510	31 044		650
				38 000	9 884	2 115		100

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
5		134	147 978	19 000	8 398	0		0
3		105	34 250	20 000	48 476	0		0
10		209	68 542	21 000	94 468	0		0
0		0	40 218	22 000	46 408	0		0
21		1 409	28 836	23 000	30 866	7		3 450
				25 000	7 494	114		1 880

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
950		4	10 302	67 500	3 506	3		2 700
2 085		10	730	70 000	11 840	57		1 391
0		0	312	72 500	4 304	301		600
0		0	272	75 000	34 126	1 439		180
0		0	48	77 500	12 122	15		105
				80 000	34 148	695		90

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	23 730,00	0,06%	23 650,00	23 775,00	31 371	51,45%	364 200	4,35%	-0,025	-169,25%
РТС	15 сен	23 815,00	0,08%	23 813,00	23 855,00	1 307	124,57%	199 790	1,29%	0,060	-48,76%

\* 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	36,78	-0,30%	0,00	0,00	0	--	0	--	0,000	100,00%