

---

## Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 05.06.2008



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

---

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	236 395	0,38%	366 364	-16,32%	220 430	-9,18%
SBER	8 284	-0,08%	125 388	-11,04%	745 398	-0,70%
GAZR	34 090	-0,49%	121 685	3,83%	236 894	-9,22%
LKOH	24 559	-0,23%	111 494	-40,26%	198 052	-7,63%
VTB	9 241	-0,61%	29 716	2,42%	264 918	-1,28%
ROSN	27 398	-0,05%	15 819	-12,57%	43 820	-10,85%
SNGR	27 869	1,32%	8 663	15,34%	88 568	-0,62%
URSI	1 316	-1,20%	7 409	-87,70%	122 690	-1,37%
GMKR	66 724	-0,14%	7 263	-40,33%	25 096	4,13%
RTSo	315	0,64%	3 746	37,77%	54 166	-0,03%
PLZL	15 099	-1,97%	1 442	-3,48%	13 116	4,71%
SBPR	5 215	1,66%	442	181,53%	3 886	-15,30%
MTSI	29 720	0,13%	80	77,78%	3 060	0,00%
NVTK	20 230	-0,02%	51	155,00%	202	98,04%
TRNF	35 750	0,28%	48	-70,19%	1 620	-2,06%
RTSc	342	0,00%	5	-61,54%	14	-41,67%
RTKM	26 731	-0,07%	1	-99,07%	648	-0,31%

### ■ Валюта (ближние фьючерсы)

---

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПбБ	13 июн	36,77	0,08%	0	--	0	--
USD/RUR / PTC	16 июн	23 728,00	-0,38%	22 572	37,47%	323 620	-6,86%

## ■ 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	66 724	-0,14%	65 871	67 520	7 263	-40,33%	25 096	4,13%	-2,60	-109,81%	-1,15%
GAZR	16 июн	34 090	-0,49%	33 836	34 450	121 685	3,83%	236 894	-9,22%	0,13	62,50%	1,13%
LKOH	16 июн	24 559	-0,23%	24 022	24 700	111 494	-40,26%	198 052	-7,63%	4,00	700,00%	4,83%
MTSI	16 июн	29 720	0,13%	28 900	29 997	80	77,78%	3 060	0,00%	-1,30	-533,33%	-12,57%
NVTK	16 июн	20 230	-0,02%	20 230	20 485	51	155,00%	202	98,04%	-1,71	-224,82%	-24,21%
PLZL	16 июн	15 099	-1,97%	14 730	15 550	1 442	-3,48%	13 116	4,71%	4,89	144,41%	9,37%
RTSc	16 июн	342	0,00%	342	342	5	-61,54%	14	-41,67%	-3,24	11,48%	-6,83%
RTSI	16 июн	236 395	0,38%	232 700	237 000	366 364	-16,32%	220 430	-9,18%	12,17	680,13%	16,58%
ROSN	16 июн	27 398	-0,05%	26 848	27 796	15 819	-12,57%	43 820	-10,85%	0,38	-54,22%	4,11%
RTSo	16 июн	315	0,64%	312	316	3 746	37,77%	54 166	-0,03%	-0,14	91,36%	-0,32%
RTKM	16 июн	26 731	-0,07%	26 731	26 731	1	-99,07%	648	-0,31%	-1,09	56,57%	-11,72%
SNGR	16 июн	27 869	1,32%	27 230	28 103	8 663	15,34%	88 568	-0,62%	3,03	20293,33%	356,61%
SBPR	16 июн	5 215	1,66%	5 136	5 241	442	181,53%	3 886	-15,30%	0,05	125,00%	2,77%
SBER	16 июн	8 284	-0,08%	8 201	8 433	125 388	-11,04%	745 398	-0,70%	0,64	56,10%	23,04%
TRNF	16 июн	35 750	0,28%	35 557	36 304	48	-70,19%	1 620	-2,06%	50,04	150,04%	4,04%
URSI	16 июн	1 316	-1,20%	1 306	1 346	7 409	-87,70%	122 690	-1,37%	0,00	-100,00%	0,00%
VTB	16 июн	9 241	-0,61%	9 175	9 374	29 716	2,42%	264 918	-1,28%	0,00	-25,00%	6,75%
GMKR	15 сен	67 700	0,67%	66 770	68 283	230	248,48%	694	33,98%	95,00	35,69%	4,54%
GAZR	15 сен	34 426	-0,22%	34 230	34 750	16 148	16,57%	55 038	73,87%	3,49	39,04%	3,27%
LKOH	15 сен	24 999	-0,09%	24 256	25 070	1 088	-72,94%	10 250	10,40%	48,00	16,79%	6,24%
MTSI	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	162	0,00%	--	--	--
NVTK	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
PLZL	15 сен	15 000	-6,26%	15 000	15 150	27	1250,00%	256	-3,03%	-5,01	-110,27%	-1,03%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	237 505	0,21%	234 655	238 195	18 190	-10,77%	37 834	70,48%	23,27	40,94%	3,42%
ROSN	15 сен	27 700	0,73%	27 250	28 000	364	-31,58%	2 424	14,56%	3,40	100,00%	3,97%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	4	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	0	--	0	0	0	--	8	0,00%	--	--	--
SBER	15 сен	85 000	1,19%	82 667	85 000	18	200,00%	116	3,57%	2,80	86,67%	10,85%
SNGR	15 сен	28 338	1,21%	27 800	28 550	192	-86,48%	15 136	1,00%	3,50	628,75%	44,32%
SBER	15 сен	0	--	0	0	0	--	12	0,00%	--	--	--
TRNF	15 сен	36 349	-0,88%	36 299	36 869	30	-14,29%	172	30,30%	649,04	-29,45%	5,64%
URSI	15 сен	1 395	5,28%	1 311	1 419	114	-70,99%	1 440	1,41%	0,08	777,78%	18,53%
VTB	15 сен	9 399	-0,38%	9 375	9 541	3 684	130,68%	44 376	18,05%	0,00	8,48%	6,19%

\* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

## ■ Опционы (июньские):

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
11		811	88 858	30 000	23 154	3 829		4 076
350		2 067	58 342	34 000	77 964	658		499
1 200		46	24 316	35 000	45 248	774		150
2 100		15 439	59 312	36 000	37 688	15 580		25
				37 000	12 624	454		15
				38 000	8 892	390		5

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
4		31	34 228	20 000	48 296	29		4 189
10		62	84 448	21 000	94 484	23		3 350
20		280	40 474	22 000	46 346	30		2 200
38		995	28 746	23 000	31 418	77		1 190
				24 000	6 112	913		600
				25 000	59 678	3 428		200

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
261		70	5 656	62 500	116	0		0
0		0	3 936	65 000	2 608	1		2 210
1 543		10	10 302	67 500	3 242	2		1 005
2 682		1	654	70 000	14 638	225		300
0		0	312	72 500	4 104	0		0
0		0	272	75 000	34 110	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	23 728,00	-0,38%	23 722,00	23 858,00	22 572	37,47%	323 620	-6,86%	-0,112	-444,62%
РТС	15 сен	23 820,00	-0,27%	23 820,00	23 930,00	5 033	-16,37%	196 974	4,53%	-0,020	-120,10%

\* 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
СПББ	13 июн	36,77	0,08%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,002	83,33%