

Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 09.06.2008



■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2357,79	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,53	-0,20%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	37,17	0,26%
EURO/USD	1,5712	-0,43%

■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	235 200	0,60%	296 151	103,54%	188 422	0,81%
SBER	7 920	0,27%	239 356	111,42%	552 784	-22,04%
GAZR	33 978	1,03%	163 908	236,90%	188 830	-18,60%
LKOH	24 430	1,00%	101 721	156,15%	194 944	1,84%
URSI	1 417	5,83%	60 142	138,00%	60 526	-45,70%
VTB	8 700	1,30%	17 979	25,05%	158 058	-38,36%
ROSN	27 938	0,18%	11 765	46,22%	28 482	-28,93%
GMKR	65 400	0,08%	6 782	31,77%	13 162	-45,94%
SNGR	27 700	0,75%	5 341	205,90%	79 128	0,58%
MTSI	30 058	3,62%	765	893,51%	2 328	-23,62%
RTSo	320	0,39%	633	-1,40%	51 176	0,00%
PLZL	14 701	-0,77%	617	11,37%	12 834	0,50%
SBPR	5 050	2,43%	529	47,35%	2 886	-26,60%
TRNF	34 942	1,55%	385	113,89%	916	-42,82%
RTKM	28 500	-1,13%	66	-56,00%	432	-21,74%
RTSc	344	--	1	--	12	-14,29%
NVTK	0	--	0	--	202	0,00%

Деривативы на акции и индексы: основные новости

[09:50] «Газпром» и Бурятия обсудили перспективы развития газоснабжения и газификации республики в рамках реализации Восточной газовой программы. /МФД-ИнфоЦентр/

[14:16] НК «Роснефть» в I квартале увеличила чистую прибыль по ОПБУ США в 7 раз до 2.564 млрд долл. /МФД-ИнфоЦентр/

[16:16] ОАО "Полюс Золото" в 2007г. уменьшило чистую прибыль по МСФО в 24.6 раза до 47.087 млн долл. /МФД-ИнфоЦентр/

[16:46] "ЛУКОЙЛ" завершил строительство Варандейского нефтеотгрузочного терминала. /МФД-ИнфоЦентр/

■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	13 июн	37,14	-0,11%	0	--	0	--
USD/RUR / РТС	16 июн	23 613,00	0,21%	34 150	328,86%	249 408	-9,63%

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

Несмотря на сочетание внешних негативных факторов, российский рынок начал неделю бурным ростом на открытии торгов. Утренние торги на азиатских рынках завершились снижением, торги в Европе также проходили преимущественно на отрицательной территории. Нефтегазовый сектор выглядел сегодня положительно, поддержку ему оказывали растущие мировые котировки на нефть. А вот сектор телекомов в последнее время выглядит привлекательным по сравнению с другими секторами. Данный сектор менее болезненно реагирует на изменение рыночной конъюнктуры. Основной причиной роста в данном секторе является заявление Александра Киселева о необходимости приватизировать Связьинвест не позднее чем в течение следующих 12 месяцев.

Индекс РТС прибавил 0,64% и составил 2357,79 пункта. Фьючерс на индекс РТС вырос в цене на 0,6% и стоит теперь 2352 пункта по шкале индекса.

На срочном рынке наблюдалась позитивная динамика. Исключениями стали фьючерсы на акции Полиусзолота и Ростелекома, потери которых составили 0,77% и 1,14%. Наиболее сильный рост наблюдался в котировках фьючерса на акции Уралсвязьинформа, который прибавил 5,83%. Фьючерс на акции МТС немного отставал и завершил торги с ростом на 3,62%. Наиболее ликвидные фьючерс на акции Газпрома и Лукойла дружно выросли в цене на 1%.

■ 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*
GMKR	16 июн	65 400	0,08%	64 700	65 776	6 782	31,77%	13 162	-45,94%	20,00	-59,16%	13,91%
GAZR	16 июн	33 978	1,03%	33 600	34 195	163 908	236,90%	188 830	-18,60%	0,68	325,00%	9,09%
LKOH	16 июн	24 430	1,00%	24 100	24 631	101 721	156,15%	194 944	1,84%	3,00	-36,17%	5,72%
MTSI	16 июн	30 058	3,62%	28 677	30 290	765	893,51%	2 328	-23,62%	0,08	101,73%	1,21%
NVTK	16 июн	0	--	0	0	0	--	202	0,00%	--	--	--
PLZL	16 июн	14 701	-0,77%	14 615	15 066	617	11,37%	12 834	0,50%	0,10	106,67%	0,30%
RTSc	16 июн	344	--	344	344	1	--	12	-14,29%	-1,61	99,53%	-5,37%
RTSI	16 июн	235 200	0,60%	233 500	242 400	296 151	103,54%	188 422	0,81%	-5,79	-23,19%	-12,37%
ROSN	16 июн	27 938	0,18%	27 305	28 298	11 765	46,22%	28 482	-28,93%	-0,17	-194,44%	-2,83%
RTSo	16 июн	320	0,39%	317	322	633	-1,40%	51 176	0,00%	0,65	-30,85%	2,34%
RTKM	16 июн	28 500	-1,13%	28 500	29 150	66	-56,00%	432	-21,74%	1,02	205,15%	15,60%
SNGR	16 июн	27 700	0,75%	27 149	28 111	5 341	205,90%	79 128	0,58%	-0,03	-150,00%	-4,91%
SBPR	16 июн	5 050	2,43%	4 990	5 078	529	47,35%	2 886	-26,60%	-0,25	69,88%	-21,42%
SBER	16 июн	7 920	0,27%	7 855	7 989	239 356	111,42%	552 784	-22,04%	0,02	-94,59%	1,15%
TRNF	16 июн	34 942	1,55%	34 550	35 430	385	113,89%	916	-42,82%	-138,00	53,54%	-17,10%
URSI	16 июн	1 417	5,83%	1 331	1 420	60 142	138,00%	60 526	-45,70%	0,01	-33,33%	18,46%
VTB	16 июн	8 700	1,30%	8 521	8 748	17 979	25,05%	158 058	-38,36%	0,00	100,00%	0,00%
GMKR	15 сен	65 769	-0,20%	65 700	66 500	1 121	0,72%	6 020	42,92%	56,90	-45,27%	2,90%
GAZR	15 сен	34 310	1,13%	34 000	34 539	25 174	70,66%	97 178	15,53%	4,00	28,62%	3,92%
LKOH	15 сен	24 621	0,90%	24 371	24 850	5 110	112,56%	21 970	25,87%	22,10	-15,33%	3,01%
MTSI	15 сен	30 633	2,45%	30 151	30 909	177	1509,09%	476	164,44%	5,83	35,90%	6,27%
NVTK	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
PLZL	15 сен	14 899	--	14 790	15 050	23	--	258	0,78%	19,90	101,34%	4,38%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	236 405	0,60%	234 900	238 050	34 670	72,35%	72 860	18,69%	6,26	-13,66%	0,96%
ROSN	15 сен	28 200	0,31%	27 630	28 480	1 780	135,45%	5 724	71,07%	2,45	1,24%	2,91%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	2	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	28 660	-1,13%	28 580	29 488	84	90,91%	200	100,00%	2,62	291,04%	2,98%
SBER	15 сен	80 974	-0,03%	79 031	81 000	30	-65,91%	120	1,69%	1,79	-24,62%	7,52%
SNGR	15 сен	28 170	0,53%	27 881	28 500	1 759	412,83%	37 386	7,13%	0,44	-14,56%	5,27%
SBER	15 сен	5 066	1,22%	5 066	5 150	6	-89,09%	62	0,00%	-28,52	0,18%	-122,38%
TRNF	15 сен	35 877	1,43%	35 700	36 000	105	483,33%	494	66,89%	797,00	20,03%	7,34%
URSI	15 сен	1 430	2,22%	1 370	1 450	4 089	392,06%	9 502	287,84%	0,02	-72,46%	4,35%
VTB	15 сен	8 858	1,06%	8 652	8 901	11 589	63,99%	181 656	176,65%	0,00	-4,24%	6,03%

* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Опционы (июньские):

БА	Объем/изменение				Открытых позиций/изменение				Put/Call	
	Call		Put		Call		Put		Ratio	HV 10 Days
GAZR-мм.гг	274 056	5252%	118 135	2290%	0	-100%	0	-100%	0,43	15,33%
GMKR-мм.гг	146	-39%	141	-73%	0	-100%	0	-100%	0,97	14,76%
LKOH-мм.гг	30 641	979%	218	-85%	0	-100%	0	-100%	0,01	25,45%
ROSN-мм.гг	0	--	0	--	0	-100%	0	-100%	--	18,36%

GAZR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
15		20 944	0	34 000	0	12 620		3
1 000		33	0	35 000	0	576		2
2 000		45 026	0	36 000	0	47 982		1
				37 000	0	672		4
				38 000	0	52 015		1
				39 000	0	160 000		1

LKOH-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	0	20 000	0	0		0
2		40	0	21 000	0	2		3 200
1		14	0	22 000	0	1		2 160
2		164	0	23 000	0	20		1 500
				24 000	0	2 081		500
				25 000	0	28 537		2

GMKR-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
12		11	0	62 500	0	0		0
10		71	0	65 000	0	85		208
1 929		1	0	67 500	0	6		25
0		0	0	70 000	0	46		1
0		0	0	72 500	0	7		1
9 600		2	0	75 000	0	2		10

ROSN-мм.гг								
Put				Call				
Цена	IV	Объем	Откр. Поз	Strike	Откр. Поз	Объем	IV	Цена
0		0	0	22 000	0	0		0
0		0	0	23 000	0	0		0
0		0	0	24 000	0	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	23 613,00	0,21%	23 489,00	23 613,00	34 150	328,86%	249 408	-9,63%	0,085	837,39%
РТС	15 сен	23 650,00	0,00%	23 577,00	23 709,00	36 355	724,19%	301 414	24,83%	0,122	63,49%

* 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	37,14	-0,11%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,027	-124,98%