

Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 10.06.2008



■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс PTC	2339,29	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,66	0,55%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,81	-0,96%
EURO/USD	1,5523	-1,20%

■ Фьючерсы на акции и индексы (июнь):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	233 300	-0,81%	298 851	0,91%	171 012	-9,24%
GAZR	33 418	-1,65%	112 242	-31,52%	54 946	-70,90%
SBER	7 876	-0,56%	103 058	-56,94%	379 926	-31,27%
LKOH	24 510	0,33%	101 645	-0,07%	128 050	-34,31%
VTB	8 460	-2,76%	52 137	189,99%	113 858	-27,96%
URSI	1 390	-1,91%	32 556	-45,87%	39 354	-34,98%
SNGR	27 349	-1,27%	25 762	382,34%	40 254	-49,13%
ROSN	27 680	-0,92%	9 299	-20,96%	17 052	-40,13%
GMKR	64 450	-1,45%	5 407	-20,27%	9 564	-27,34%
PLZL	14 950	1,69%	1 827	196,11%	10 006	-22,04%
RTSo	315	-1,39%	1 194	88,63%	51 102	-0,14%
SBPR	4 960	-1,78%	735	38,94%	2 066	-28,41%
TRNF	34 200	-2,12%	141	-63,38%	682	-25,55%
MTSI	29 500	-1,86%	68	-91,11%	2 224	-4,47%
RTKM	27 960	-1,89%	47	-28,79%	338	-21,76%
NVTK	19 600	--	35	--	180	-10,89%
RTSc	0	-100,00%	0	-100,00%	12	0,00%

Деривативы на акции и индексы: основные новости

[14:15] "Норникель" в 2007 г. снизил чистую прибыль по МСФО на 11.6% до 5.276 млрд долл. /МФД-ИнфоЦентр/
 [14:30] «Полюс Золото» в 2007 г. снизил чистую прибыль по МСФО на 95.94% до 47.087 млн долл. /МФД-ИнфоЦентр/
 [14:45] «Газпром» и Таджикистан обсудили состояние двусторонних отношений. /МФД-ИнфоЦентр/

Валютные деривативы: основные новости

[11:41] Промышленное производство во Франции за апрель выросло на 1.4% м/м. Значение за предыдущий месяц: снижение на 0.8% м/м. /МФД-ИнфоЦентр/
 [12:41] Промышленное производство в Великобритании за апрель выросло на 0.2% г/г. Предыдущее значение: рост на 0.2% г/г. Прогноз аналитиков: рост на 0.1% г/г. /МФД-ИнфоЦентр/
 [16:34] Сальдо торгового баланса США за апрель (-60.9) млрд долл. /МФД-ИнфоЦентр/
 [17:26] Дефицит торгового баланса США в апреле расширился более, чем ожидалось на фоне рекордно высоких цен на нефть и выросшего потребления импортируемой нефти. /МФД-ИнфоЦентр/

■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	13 июн	36,81	-0,89%	0	--	0	--
USD/RUR / PTC	16 июн	23 673,00	0,25%	79 727	133,46%	152 526	-38,84%

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

Внешние факторы, которые уже второй день отличаются негативной окраской, сегодня наконец то сломили «бычий» настрой инвесторов и двинули отечественные индексы вниз. Выступление главы ФРС Бена Бернанке дало понять инвесторам, что рассчитывать на дальнейшее снижение процентной политики не приходится. Статистика по экономике США, опубликованная сегодня вечером, не оказала заметного влияния на рынок. Внешнеторговый дефицит США в апреле вырос до \$60,9 млрд., в то время как рынок ожидал роста до \$60 млрд.

Индекс РТС сегодня просел на 0,78%, в итоге значение основного индикатора составило 2339,29 пункта. Фьючерс на индекс РТС потерял 0,81%, в результате чего стоимость фьючерса составила 2333 пунктов по шкале индекса.

На срочном рынке несмотря на всеобщее негативные настроения есть позитивные проблески. Фьючерс на акции выросли в цене на 0,33%, фьючерс на акции Полиэзолота прибавил 1,69%. Банковский сектор выглядел негативно. Фьючерсы на акции Сбербанка и ВТБ просели на 0,56% и 2,76%. Негативная финансовая отчетность Норникеля плохо сказалась на динамике торгов, по итогам дня фьючерс на акции данного эмитента потерял 1,45%.

■ 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	Доход-ть СПОТ-Ф ^А
GMKR	16 июн	64 450	-1,45%	64 111	65 850	5 407	-20,27%	9 564	-27,34%	-10,00	-150,00%	-8,20%
GAZR	16 июн	33 418	-1,65%	33 235	34 187	112 242	-31,52%	54 946	-70,90%	-0,52	-176,47%	-8,22%
LKOH	16 июн	24 510	0,33%	23 861	24 725	101 645	-0,07%	128 050	-34,31%	1,00	-66,67%	2,16%
MTSI	16 июн	29 500	-1,86%	29 097	29 985	68	-91,11%	2 224	-4,47%	0,17	112,50%	2,92%
NVTK	16 июн	19 600	--	19 600	20 300	35	--	180	-10,89%	-1,53	99,24%	-39,32%
PLZL	16 июн	14 950	1,69%	14 651	15 080	1 827	196,11%	10 006	-22,04%	12,20	12100,00%	41,65%
RTSc	16 июн	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	12	0,00%	--	--	--
RTSI	16 июн	233 300	-0,81%	231 170	236 900	298 851	0,91%	171 012	-9,24%	-6,29	-8,64%	-15,80%
ROSN	16 июн	27 680	-0,92%	27 300	28 150	9 299	-20,96%	17 052	-40,13%	0,93	647,06%	17,83%
RTSo	16 июн	315	-1,39%	313	316	1 194	88,63%	51 102	-0,14%	-1,12	-272,31%	-4,75%
RTKM	16 июн	27 960	-1,89%	27 842	28 430	47	-28,79%	338	-21,76%	1,05	2,94%	19,10%
SNGR	16 июн	27 349	-1,27%	27 062	27 700	25 762	382,34%	40 254	-49,13%	0,02	163,33%	3,68%
SBPR	16 июн	4 960	-1,78%	4 600	5 020	735	38,94%	2 066	-28,41%	-0,04	84,00%	-4,09%
SBER	16 июн	7 876	-0,56%	7 750	7 960	103 058	-56,94%	379 926	-31,27%	-0,10	-600,00%	-6,71%
TRNF	16 июн	34 200	-2,12%	33 704	34 800	141	-63,38%	682	-25,55%	-80,00	42,03%	-11,84%
URSI	16 июн	1 390	-1,91%	1 377	1 464	32 556	-45,87%	39 354	-34,98%	0,01	-16,67%	18,29%
VTB	16 июн	8 460	-2,76%	8 395	8 738	52 137	189,99%	113 858	-27,96%	0,00	--	-6,25%
GMKR	15 сен	65 300	-0,71%	65 100	66 000	2 478	121,05%	9 160	52,16%	75,00	31,81%	3,80%
GAZR	15 сен	33 830	-1,40%	33 730	34 438	56 537	124,58%	192 658	98,25%	3,60	-10,00%	3,51%
LKOH	15 сен	24 735	0,46%	24 055	24 933	23 368	357,30%	44 130	100,86%	23,50	6,33%	3,13%
MTSI	15 сен	30 158	-1,55%	30 122	30 330	43	-75,71%	502	5,46%	6,75	15,78%	7,15%
NVTK	15 сен	0	--	0	0	0	--	10	0,00%	--	--	--
PLZL	15 сен	15 133	1,57%	14 700	15 159	137	495,65%	6 362	2365,89%	30,50	53,27%	6,43%
RTSc	15 сен	0	--	0	0	0	--	0	--	--	--	--
RTSI	15 сен	234 290	-0,89%	232 230	237 595	86 690	150,04%	109 344	50,07%	3,61	-42,33%	0,55%
ROSN	15 сен	27 998	-0,72%	27 546	28 380	3 592	101,80%	7 650	33,65%	4,11	67,76%	4,87%
RTSo	15 сен	0	--	0	0	0	--	2	0,00%	--	--	--
RTKM	15 сен	27 865	-2,77%	27 865	28 630	42	-50,00%	182	-9,00%	0,10	-96,18%	0,11%
SBER	15 сен	80 000	-1,20%	78 500	80 000	22	-26,67%	140	16,67%	1,14	-36,45%	4,72%
SNGR	15 сен	27 770	-1,42%	27 636	28 550	2 922	66,12%	51 150	36,82%	0,44	0,00%	5,26%
SBER	15 сен	5 077	0,22%	5 074	5 140	36	500,00%	132	112,90%	-28,09	1,51%	-118,74%
TRNF	15 сен	35 100	-2,17%	34 959	35 480	124	18,10%	722	46,15%	820,00	2,89%	7,47%
URSI	15 сен	1 429	-0,07%	1 410	1 465	13 405	227,83%	29 898	214,65%	0,04	131,58%	9,91%
VTB	15 сен	8 633	-2,54%	8 550	8 877	24 822	114,19%	231 616	27,50%	0,00	3,16%	6,28%

* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ 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	23 673,00	0,25%	23 590,00	23 685,00	79 727	133,46%	152 526	-38,84%	0,016	-81,13%
РТС	15 сен	23 760,00	0,47%	23 685,00	23 780,00	34 502	-5,10%	397 658	31,93%	0,103	-15,44%

* 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	36,81	-0,89%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,002	92,73%