

# Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 16.06.2008



## ■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2366,32	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,74	0,19%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,57	-0,38%
EURO/USD	1,5473	-0,42%

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

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	237 990	0,42%	459 788	276,99%	157 722	1,12%
GAZR	34 870	1,06%	75 014	25,15%	207 740	0,73%
LKOH	25 022	-0,24%	62 582	95,92%	59 206	-7,70%
VTB	8 630	-0,63%	22 453	-11,02%	282 528	3,24%
URSI	1 395	-0,64%	10 385	-16,53%	54 014	27,30%
SNGR	27 980	-0,50%	9 265	248,44%	57 228	8,45%
ROSN	28 018	-0,29%	3 555	14,46%	10 388	11,03%
GMKR	65 197	0,79%	3 221	-48,08%	17 012	8,37%
RTSo	324	--	837	--	1 628	81300,00%
PLZL	15 290	0,66%	204	240,00%	6 696	4,33%
RTKM	27 774	-3,90%	124	933,33%	308	63,83%
SBER	80 100	-0,47%	116	141,67%	196	40,00%
TRNF	34 415	-2,02%	97	-29,71%	898	6,65%
MTSI	30 083	-0,10%	32	-91,04%	910	6,31%
NVTK	20 490	1,39%	12	140,00%	34	70,00%
RTSc	345	--	8	--	16	--
SBER	0	--	0	--	132	0,00%

## ■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	15 июл	36,57	-0,30%	0	--	0	--
USD/RUR / СПББ	15 июл	23,78	0,46%	0	--	0	--
USD/RUR / РТС	15 сен	23 760,00	-0,16%	21 123	284,96%	492 682	2,22%

## Деривативы на акции и индексы: основные новости

[13:02] Капвложения "Газпрома" в реконструкцию и перевооружение единой системы газоснабжения составили в 2007 г 39,1 млрд руб. /ПРАЙМ-ТАСС/  
 [13:10] "Газпром" планирует с 2011 по 2030 гг увеличить ресурсы на шельфе на 2,2 трлн куб м газа и 90 млн т нефти. /ПРАЙМ-ТАСС/  
 [13:28] Инвестиции ОАО "Газпром" в развитие до 2020 г составят 8-10 трлн руб. /ПРАЙМ-ТАСС/  
 [13:32] Добыча "Газпрома" в 2008 г ожидается на уровне 561 млрд куб м газа. /ПРАЙМ-ТАСС/  
 [14:17] "Газпром" оценивает суммарные инвестиции в газотранспортную систему к 2020 г в сумму от 80 до 90 млрд долл. /ПРАЙМ-ТАСС/

## Валютные деривативы: основные новости

[14:36] Индекс потребительских цен в Еврозоне (CPI) за май в годовом исчислении вырос на 3.7% против 3.6% в апреле. Аналитики прогнозировали рост на 3.6%. /МФД-ИнфоЦентр/  
 [14:37] Индекс потребительских цен в Еврозоне за май вырос на 0.6%. /МФД-ИнфоЦентр/  
 [17:20] По данным Казначейства США приток капитала за апрель 60.6 млрд. долл. против (-48.7) млрд. долл. в марте. Аналитики ожидали 63 млрд долл. /МФД-ИнфоЦентр/

---

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

Отыгрыш позитива завершен

Сегодня российский рынок отыгрывал позитив пятничных торгов в Америке и Европе. С утра в плюсе оказались и азиатские рынки. В итоге индекс РТС за день прибавил 0,41%, а фьючерс в основную торговую сессию прирос на 0,42%. Индекс ММВБ вырос скромнее, прибавив 0,29%.

Фьючерсы на американские индексы торговались с небольшим снижением: SnP терял 0,51%, а NASDAQ100 0,48%. Спотовые значения индексов демонстрируют разнонаправленную динамику: DJIA падает на 0,38%, а NASDAQ растет на 0,02%.

Нефть на ICE растет на 2,09%, и стоит \$137.94. Ожидается выход позитивных данных о запасах нефти в США. Это может оказать негативное влияние на рынок нефти в краткосрочном периоде. Такой сценарий может усугубиться из-за сокращения спроса американцев в разгар «автомобильного сезона», что может обрушить стоимость контракта. Золото в РТС торговалось с небольшим повышением. Рост составил 0,75% и теперь унция стоит \$899,7.

На рынке FORTS наблюдались разнонаправленные движения фьючерсных контрактов. Фьючерсы на акции Газпрома и Новатэка прибавили 1,06% и 1,39%. Фьючерсы на акции нетедобывающих компаний показали снижение цены, по итогам торгов контракт на акции Лукойла, Роснефти и Сургутнефтегаза просели на 0,24%, 0,29% и 0,5%

## ■ Рынок индексных деривативов и деривативов на акции: итоги торгов

### Фьючерсы (сентябрьские): \*

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	15 сен	65 197	0,79%	63 805	66 000	3 221	-48,08%	17 012	8,37%	91,70	-8,21%	5,10%
GAZR	15 сен	34 870	1,06%	34 207	35 168	75 014	25,15%	207 740	0,73%	2,70	33,00%	2,79%
LKOH	15 сен	25 022	-0,24%	24 801	25 367	62 582	95,92%	59 206	-7,70%	14,08	1180,00%	2,02%
MTSI	15 сен	30 083	-0,10%	29 900	30 305	32	-91,04%	910	6,31%	2,71	-55,72%	3,17%
NVTK	15 сен	20 490	1,39%	20 390	20 580	12	140,00%	34	70,00%	0,50	-76,19%	0,85%
PLZL	15 сен	15 290	0,66%	15 100	15 350	204	240,00%	6 696	4,33%	23,50	-18,69%	5,43%
RTSc	15 сен	345	--	345	345	8	--	16	--	3,23	100,94%	0,82%
RTSI	15 сен	237 990	0,42%	233 605	239 550	459 788	276,99%	157 722	1,12%	13,58	2,57%	2,22%
ROSN	15 сен	28 018	-0,29%	27 897	28 348	3 555	14,46%	10 388	11,03%	0,78	-60,80%	1,00%
RTSo	15 сен	324	--	322	325	837	--	1 628	81300,00%	3,35	101,05%	0,91%
RTKM	15 сен	27 774	-3,90%	27 620	27 920	124	933,33%	308	63,83%	-0,26	-102,00%	-0,33%
SBER	15 сен	80 100	-0,47%	78 501	80 900	116	141,67%	196	40,00%	1,21	-38,73%	5,48%
SNGR	15 сен	27 980	-0,50%	27 884	28 401	9 265	248,44%	57 228	8,45%	0,27	-30,95%	3,49%
SBER	15 сен	0	--	0	0	0	--	132	0,00%	--	--	--
TRNF	15 сен	34 415	-2,02%	34 150	34 849	97	-29,71%	898	6,65%	867,02	-34,02%	8,98%
URSI	15 сен	1 395	-0,64%	1 390	1 435	10 385	-16,53%	54 014	27,30%	0,02	-50,00%	5,05%
VTB	15 сен	8 630	-0,63%	8 551	8 755	22 453	-11,02%	282 528	3,24%	0,00	-56,10%	3,77%
GAZR	15 дек	35 450	1,01%	35 402	35 490	6	-50,00%	104	8,33%	8,50	6,92%	4,30%
LKOH	15 дек	25 251	-89,43%	25 251	25 251	1	-97,30%	2	-99,78%	36,98	-99,83%	2,60%
RTSI	15 дек	240 350	--	235 150	244 000	427	--	1 430	--	37,18	101,58%	3,04%

\* 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
СПВБ	15 июл	23,78	0,46%	0,00	0,00	0	--	0	--	0,043	288,89%
PTC	15 сен	23 760,00	-0,16%	23 720,00	23 892,00	21 123	284,96%	492 682	2,22%	0,023	-78,47%
PTC	15 дек	23 886,00	0,08%	23 886,00	23 996,00	2 710	--	112 258	-3,61%	0,149	-15,38%

\* 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	15 июл	36,57	-0,30%	0,00	0,00	0	--	0	--	0,005	120,08%