

# Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 18.06.2008



## ■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2399,74	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,67	0,03%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,73	0,11%
EURO/USD	1,5488	-0,12%

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

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	241 055	-0,16%	575 282	20,17%	190 262	1,49%
GAZR	35 480	0,12%	103 084	40,69%	226 834	6,61%
LKOH	24 900	-0,59%	49 171	2,60%	60 270	-12,30%
VTB	8 703	-1,53%	21 514	-5,18%	292 348	2,11%
SNGR	27 969	-0,40%	7 838	-37,36%	65 722	-4,07%
GMKR	64 500	-0,92%	7 195	-43,66%	31 326	9,05%
URSI	1 411	-0,28%	5 734	3,67%	62 872	7,73%
ROSN	28 360	-0,49%	5 031	5,47%	12 378	6,10%
RTSo	325	-0,57%	1 179	88,64%	368	-82,10%
MTSI	30 265	-0,93%	890	641,67%	2 040	94,66%
PLZL	15 071	-0,52%	154	57,14%	6 818	0,00%
RTKM	27 540	-0,58%	112	433,33%	546	63,47%
SBER	81 500	-0,85%	94	-54,81%	252	0,00%
TRNF	34 545	-0,88%	43	-89,71%	1 348	3,22%
NVTK	21 060	1,06%	18	-14,29%	60	42,86%
SBER	5 131	2,01%	12	-71,43%	130	-2,99%
RTSc	349	--	1	--	18	12,50%

## Деривативы на акции и индексы: основные новости

[10:51] Экспортная выручка "Газпрома" за 2007 г выросла на 5 проц и составила 39,5 млрд долл. /ПРАЙМ-ТАСС/

[10:55] Ожидаемая выручка "Газпрома" от продажи газа в дальнее зарубежье в первом полугодии 2008 г составит 33,2 млрд долл. /ПРАЙМ-ТАСС/

[11:00] Планируемые поставки ОАО "Газпром" в страны дальнего зарубежья в текущем году ожидаются на уровне 163 млрд куб. /ПРАЙМ-ТАСС/

[11:33] М.Прохоров не планирует увеличивать долю в "Получ Золото" - интервью "Коммерсанту"./ПРАЙМ-ТАСС/

[12:04] ВТБ приступил к размещению 3-летних евробондов на 500 млн долл, ориентир доходности - 7,2 проц годовых. /ПРАЙМ-ТАСС/

[16:59] Сбербанк РФ может увеличить объем привлеченных средств на рынке до 5 млрд долл в 2008 г. /ПРАЙМ-ТАСС/

## ■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	15 июл	36,68	-0,03%	0	--	0	--
USD/RUR / СПББ	15 июл	23,66	0,08%	0	--	0	--
USD/RUR / РТС	15 сен	23 765,00	0,05%	14 224	-20,58%	527 478	4,40%

---

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

В среду российский рынок выглядел очень волатильным. На открытии, при достаточно противоречивом внешнем фоне (американские индексы закрылись в минусе, а азиатские рынки вышли в плюс), российские фондовые индексы демонстрировали рост. Даже негативная динамика на европейских площадках не сломала настрой «быков». Но уже в середине дня произошла смена восходящего тренда на нисходящий. Вышедшая статистика по запасам топлива в США оказалась смешанной. Согласно данным произошло резкое снижение запасов бензина, однако запасы дистилляторов увеличилось больше, чем предполагалось.

Индекс РТС прибавил сегодня 0,15% и составил на конец торговой сессии 2402,74 пункта. Фьючерс на индикатор фондовой биржи РТС завершил день с отрицательным результатом, потери контракта составили 0,16% и в итоге фьючерс стоит теперь 2410,55 пункта по шкале индекса.

На срочном рынке сплошной негатив. Сектор телекомов, представленный фьючерсами на акции Ростелекома и МТС понес потери на 0,58% и 0,93%. Банковский сектор закрылся разнонаправлено, по итогам дня фьючерс на акции Сбербанка вырос на 2%, а вот фьючерс на акции ВТБ просел на 1,53%. Фьючерсы на акции нефтедобывающих компаний также находились на отрицательной территории, по итогам дня снижение цены фьючерсов на акции Сургутнефтегаза, Лукойла и Роснефти составило 0,4%, 0,6% 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	Доход-ть СПОТ-Ф <sup>А</sup>
GMKR	15 сен	64 500	-0,92%	64 253	65 609	7 195	-43,66%	31 326	9,05%	27,00	-42,55%	1,54%
GAZR	15 сен	35 480	0,12%	35 205	35 854	103 084	40,69%	226 834	6,61%	3,50	7,03%	3,64%
LKOH	15 сен	24 900	-0,59%	24 811	25 249	49 171	2,60%	60 270	-12,30%	11,00	-14,73%	1,62%
MTSI	15 сен	30 265	-0,93%	30 265	30 505	890	641,67%	2 040	94,66%	3,00	-30,88%	3,57%
NVTK	15 сен	21 060	1,06%	21 048	21 660	18	-14,29%	60	42,86%	1,39	147,93%	2,37%
PLZL	15 сен	15 071	-0,52%	15 071	15 256	154	57,14%	6 818	0,00%	13,10	-34,43%	3,12%
RTSc	15 сен	349	--	349	349	1	--	18	12,50%	2,58	100,75%	0,67%
RTSI	15 сен	241 055	-0,16%	240 120	243 345	575 282	20,17%	190 262	1,49%	10,81	-29,58%	1,78%
ROSN	15 сен	28 360	-0,49%	28 280	28 828	5 031	5,47%	12 378	6,10%	1,25	-28,57%	1,62%
RTSo	15 сен	325	-0,57%	325	329	1 179	88,64%	368	-82,10%	1,07	-45,96%	0,30%
RTKM	15 сен	27 540	-0,58%	27 500	27 770	112	433,33%	546	63,47%	2,29	349,02%	2,99%
SBER	15 сен	81 500	-0,85%	80 475	82 600	94	-54,81%	252	0,00%	0,85	-26,09%	3,85%
SNGR	15 сен	27 969	-0,40%	27 727	28 455	7 838	-37,36%	65 722	-4,07%	0,15	55,79%	1,95%
SBER	15 сен	5 131	2,01%	5 131	5 170	12	-71,43%	130	-2,99%	-29,34	4,59%	-136,19%
TRNF	15 сен	34 545	-0,88%	34 250	34 870	43	-89,71%	1 348	3,22%	795,00	44,60%	8,37%
URSI	15 сен	1 411	-0,28%	1 393	1 427	5 734	3,67%	62 872	7,73%	0,03	0,00%	7,72%
VTB	15 сен	8 703	-1,53%	8 677	8 860	21 514	-5,18%	292 348	2,11%	0,00	25,51%	5,24%
GAZR	15 дек	35 876	-0,34%	35 874	36 004	8	33,33%	122	5,17%	7,46	-16,18%	3,76%
LKOH	15 дек	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	4	0,00%	--	--	--
RTSI	15 дек	242 625	-0,48%	240 465	245 500	330	-41,39%	1 756	1,27%	26,51	-31,85%	2,16%

\* 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	23,66	0,08%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,009	60,87%
PTC	15 сен	23 765,00	0,05%	23 730,00	23 780,00	14 224	-20,58%	527 478	4,40%	0,096	7,87%
PTC	15 дек	23 865,00	-0,05%	23 836,00	23 865,00	12	-55,56%	112 332	0,02%	0,196	-7,98%

\* 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	36,68	-0,03%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,050	--