

# Ежедневный обзор Российского рынка деривативов За 19.06.2008



## ■ Индикаторы:

Показатель	Значение	Изменение
Индекс РТС	2400,84	0,26%
USD/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	23,67	0,01%
EUR/RUB_UTS_TOD (ММВБ)	36,73	-0,01%
EURO/USD	1,5499	0,07%

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

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	240 375	-0,28%	604 708	5,12%	204 004	7,22%
GAZR	35 371	-0,31%	93 566	-9,23%	238 126	4,98%
LKOH	24 580	-1,29%	43 335	-11,87%	70 598	17,14%
VTB	8 723	0,23%	25 584	18,92%	296 964	1,58%
URSI	1 407	-0,28%	9 899	72,64%	65 302	3,86%
SNGR	28 137	0,60%	7 329	-6,49%	65 650	-0,11%
GMKR	64 697	0,31%	4 065	-43,50%	30 622	-2,25%
ROSN	28 215	-0,51%	3 529	-29,85%	12 814	3,52%
RTSo	324	-0,15%	2 022	71,50%	2 100	470,65%
SBER	5 078	-1,03%	184	1433,33%	472	263,08%
TRNF	34 597	0,15%	184	327,91%	1 408	4,45%
MTSI	29 828	-1,44%	136	-84,72%	2 266	11,08%
SBER	80 850	-0,80%	116	23,40%	152	-39,68%
PLZL	14 951	-0,80%	114	-25,97%	6 892	1,09%
NVTK	21 320	1,23%	24	33,33%	86	43,33%
RTKM	27 500	-0,15%	11	-90,18%	538	-1,47%
RTSc	0	-100,00%	0	-100,00%	18	0,00%

## ■ Валюта (ближние фьючерсы)

БА/Биржа	Исп-е	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
EURO/RUR / СПББ	15 июл	36,68	0,00%	0	--	0	--
USD/RUR / СПББ	15 июл	23,66	0,00%	0	--	0	--
USD/RUR / РТС	15 сен	23 765,00	0,00%	19 012	33,66%	529 476	0,38%

---

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

Высокая волатильность по прежнему сохраняется на российском рынке. Открытие прошло на отрицательной территории, из-за внешнего негативного фона. Американские рынки закрылись в минусе вчера Dow-Jones откатился на 1,08%, S&P 500 потерял 0,97%, Nasdaq опустился на 1,14% на фоне очередных опасений снижения прибылей компаний и возможного усугубления ситуации в мировом финансовом секторе. Но, тем не менее, утренний негатив быстро сменился позитивными настроениями. На рынке наблюдается неуверенность на низких объемах.

Индекс РТС сегодня просел по отношению ко вчерашнему закрытию на 0,08% и составил 2400,84 пункта. Фьючерс на индекс РТС просел на 0,28% и стоит теперь 2403,75 пунктов по шкале индекса.

На срочном рынке в целом наблюдалась негативная динамика. По итогам дня фьючерсы на акции Лукойла и Роснефти потеряли 1,49% и 0,5%, а вот фьючерс на акции Сургутнефтегаза закрылся в плюсе, с результатом 0,6%. Фьючерс на акции Норникеля также завершил торговую сессию на положительной территории, по итогам дня рост цены контракта составил 0,31%.

## ■ 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	64 697	0,31%	64 000	65 027	4 065	-43,50%	30 622	-2,25%	29,80	10,37%	1,71%
GAZR	15 сен	35 371	-0,31%	35 042	35 689	93 566	-9,23%	238 126	4,98%	3,06	-12,57%	3,23%
LKOH	15 сен	24 580	-1,29%	24 560	24 955	43 335	-11,87%	70 598	17,14%	11,00	0,00%	1,66%
MTSI	15 сен	29 828	-1,44%	29 828	29 955	136	-84,72%	2 266	11,08%	3,88	29,33%	4,75%
NVTK	15 сен	21 320	1,23%	21 060	21 397	24	33,33%	86	43,33%	3,85	176,98%	6,62%
PLZL	15 сен	14 951	-0,80%	14 951	15 095	114	-25,97%	6 892	1,09%	14,10	7,63%	3,43%
RTSc	15 сен	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	18	0,00%	--	--	--
RTSI	15 сен	240 375	-0,28%	239 050	242 400	604 708	5,12%	204 004	7,22%	2,91	-73,08%	0,49%
ROSN	15 сен	28 215	-0,51%	28 000	28 466	3 529	-29,85%	12 814	3,52%	1,73	38,40%	2,28%
RTSo	15 сен	324	-0,15%	323	327	2 022	71,50%	2 100	470,65%	1,37	28,04%	0,39%
RTKM	15 сен	27 500	-0,15%	27 270	27 500	11	-90,18%	538	-1,47%	3,80	65,94%	5,04%
SBER	15 сен	80 850	-0,80%	80 850	81 400	116	23,40%	152	-39,68%	0,63	-25,88%	2,91%
SNGR	15 сен	28 137	0,60%	27 600	28 698	7 329	-6,49%	65 650	-0,11%	0,16	6,08%	2,08%
SBER	15 сен	5 078	-1,03%	4 980	5 124	184	1433,33%	472	263,08%	-29,44	-0,34%	-139,01%
TRNF	15 сен	34 597	0,15%	33 389	34 600	184	327,91%	1 408	4,45%	457,00	-42,52%	4,82%
URSI	15 сен	1 407	-0,28%	1 391	1 418	9 899	72,64%	65 302	3,86%	0,03	6,67%	8,36%
VTB	15 сен	8 723	0,23%	8 601	8 818	25 584	18,92%	296 964	1,58%	0,00	-32,52%	3,55%
GAZR	15 дек	0	-100,00%	0	0	0	-100,00%	122	0,00%	--	--	--
LKOH	15 дек	25 290	--	25 290	25 345	2	--	8	100,00%	82,00	103,31%	5,97%
RTSI	15 дек	243 150	0,22%	241 475	244 700	687	108,18%	1 918	9,23%	30,66	15,65%	2,51%

\* 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	0,00%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,011	-16,67%
PTC	15 сен	23 765,00	0,00%	23 675,00	23 770,00	19 012	33,66%	529 476	0,38%	0,095	-1,56%
PTC	15 дек	23 874,00	0,04%	0,00	0,00	0	-100,00%	112 332	0,00%	0,204	3,83%

\* 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	0,00%	0,00	0,00	0	--	0	--	-0,045	9,80%