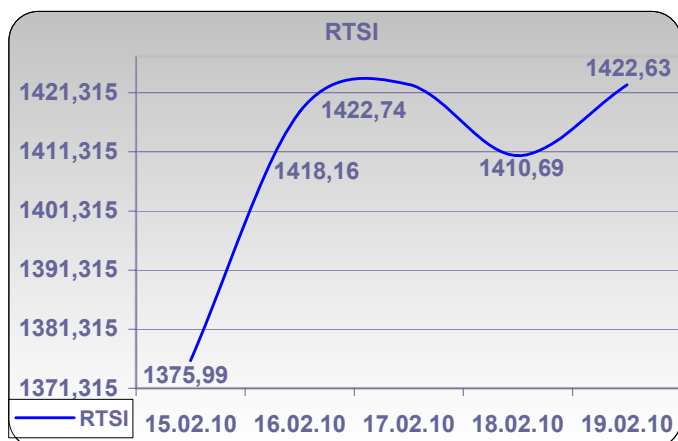


Еженедельный обзор российского рынка индексных деривативов и деривативов на акции За 15 – 19 февраля 2010 года



■ Индекс РТС:



■ Краткие итоги по ближним фьючерсам (июньские):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	142 570	4,68%	3 993 030	-30,16%	379 942	1,70%
SBER	7 941	-1,08%	2 100 397	-34,15%	523 292	-10,23%
GAZR	17 199	5,26%	1 046 294	-24,44%	313 516	-10,35%
LKOH	15 895	4,74%	246 959	-36,34%	162 466	1,90%
VTB	7 415	5,01%	57 848	-23,60%	37 756	-7,53%
ROSN	23 659	6,14%	51 860	-30,27%	30 718	18,10%
SBPR	6 511	0,28%	47 303	-23,49%	40 642	-14,56%
GMKR	47 224	6,84%	26 649	-35,95%	10 684	-18,18%
URSI	857	-0,46%	8 439	-55,09%	37 510	-13,83%
SNGR	24 970	4,70%	5 699	-27,57%	3 796	-24,05%
TRNF	23 919	4,00%	1 075	-5,20%	1 262	-4,39%
MTSI	23 083	0,93%	629	-30,34%	1 108	-7,67%
PLZL	14 577	-2,68%	487	-60,95%	3 094	-8,62%
RTKM	14 272	-2,89%	54	-14,29%	776	-5,37%
NVTK	17 466	1,75%	0	-100,00%	396	0,00%

Неделя прошла в позитивных тонах

На прошедшей неделе существенными для развития ситуации на фондовых площадках России оказались следующие факторы. Во-первых, это рост запасов дистиллятов в Штатах по итогам отчета Министерства энергетики, в результате этого происходит существенный скачок нефтяных котировок, и он отражается на торгах в конце недели. Вторым важным событием был саммит ЕС, на котором обсуждался греческий долг – игроки оценили старания европейских лидеров и курс евро по отношению к основным валютам претерпел рост. Негативно отчитались американцы в четверг – был зафиксирован неожиданный сильный рост заявок на пособие по безработице. В результате этот день стал единственным, на неделе, когда торги завершились в красной зоне. В пятницу был опубликован индекс потребительской инфляции, выросший слабее, чем прогнозировалось, и послужил причиной для роста как в Штатах, так и в России на фоне подешевления доллара. К закрытию вечерних торгов в пятницу индекс РТС составлял 1425,02 пункта (+4,28% за неделю).

На рынке FORTS котировки основных фондовых и индексных инструментов оказались в зеленой зоне. Лишь фьючерсы на об. акции Сбербанка с поставкой в марте подешевели на 1,08%. Контракты на об. акции Газпрома и Лукойла за неделю подорожали на 5,26% и 4,74%. Контракты на Роснефть, обладая повышенной волатильностью, выросли больше: они прибавили 6,14%. Рост открытых позиций по этому инструменту составил 18,1%. Однако открытый интерес кроме как по этим бумагам увеличивался лишь по фьючерсам на индекс РТС и Лукойл (+1,7% и +1,9%). Сокращение числа открытых позиций по Газпрому и Сбербанку составило более 10%. Игроки не хотели выносить открытые позиции на февральские праздники. По итогам недели фьючерс на индекс РТС с поставкой в марте остался в контанго, но он заходил в недолгую бэквардацию.

В целом, сейчас настроения на рынках зависят от информации от выступлений Бена Бернанке, и от ожиданий инвесторов по поводу него.

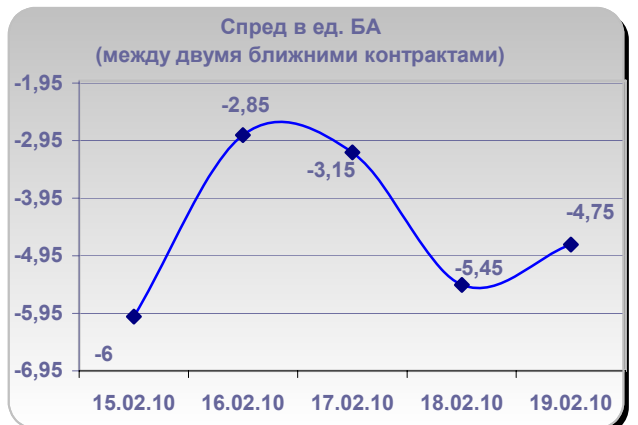
■ Фьючерсы: итоги торгов *

Код БА	Исп-е	Цена	Изм-е	Low	High	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е	Базис	(на	Изм-е	Дох-ть СПОТ-
GMKR	15 мар	44 199	-1,57%	43 341	46 390	41 605	1,84%	13 058	-3,55%	8,90	68%	1,98%	
GAZR	15 мар	16 340	-10,81%	16 271	18 516	1 384 693	36,42%	349 700	19,93%	0,36	-60%	2,26%	
LKOH	15 мар	15 175	-6,04%	15 175	16 377	387 949	12,28%	159 444	21,53%	0,50	125%	0,34%	
MTSI	15 мар	22 870	0,26%	22 061	23 299	903	-23,08%	1 200	2,74%	0,73	-34%	2,90%	
NVTK	15 мар	17 165	-5,37%	0	16 800	200	9900,00%	396	-8,76%	1,15	-89%	6,10%	
PLZL	15 мар	14 979	-0,13%	13 560	14 990	1 247	76,38%	3 386	22,59%	49,91	-33%	30,97%	
RTSc	15 мар	241	0,00%	0	0	0	-100,00%	0	--	-7,14	-3%	-1,82%	
RTSI	15 мар	136 200	-3,73%	135 195	143 000	5 717 691	29,50%	373 604	-7,47%	-1,83	-151%	-1,49%	
ROSN	15 мар	22 290	-0,89%	21 647	22 819	74 369	26,41%	26 010	-2,30%	0,30	-78%	1,32%	
RTSo	15 мар	188	-0,45%	0	0	0	-100,00%	0	--	21,02	49%	10,14%	
RTKM	15 мар	14 697	-2,67%	13 951	15 300	63	-74,39%	820	-3,30%	1,20	233%	7,44%	
SNGR	15 мар	23 850	-2,93%	23 729	24 999	7 868	25,01%	4 998	7,81%	-0,05	60%	-2,09%	
SBPR	15 мар	6 493	-5,41%	6 410	6 940	61 823	5,03%	47 568	-9,72%	0,93	272%	14,22%	
SBER	15 мар	8 028	-3,87%	7 853	8 443	3 189 508	48,08%	582 922	-11,94%	0,28	-33%	3,55%	
TRNF	15 мар	23 000	-6,12%	22 930	24 999	1 134	-18,94%	1 320	-41,64%	10,02	-96%	0,43%	
URSI	15 мар	861	-4,12%	840	920	18 792	-68,11%	43 532	-1,14%	0,00	-87%	2,10%	
VTB	15 мар	7 061	-2,57%	7 000	7 380	75 713	-8,94%	40 832	-5,97%	0,00	-104%	-1,25%	
GMKR	15 июн	43 867	-5,82%	0	43 365	5	--	150	-6,25%	-24,30	-114%	-1,36%	
GAZR	15 июн	16 611	-10,40%	16 500	18 763	1 606	-40,80%	5 176	25,45%	3,07	-1%	4,73%	
LKOH	15 июн	15 275	-6,63%	15 275	16 500	946	375,38%	1 726	89,67%	10,50	-45%	1,74%	
MTSI	15 июн	23 013	-2,97%	0	0	0	--	0	--	2,16	-79%	2,16%	
NVTK	15 июн	16 912	-8,72%	0	0	0	-100,00%	2	0,00%	-1,38	-110%	-1,78%	
PLZL	15 июн	14 704	-0,88%	0	0	0	--	2	0,00%	22,41	-62%	3,52%	
RTSI	15 июн	136 000	-3,95%	135 000	142 875	2 167	120,90%	39 406	1250,45%	-3,83	-180%	-0,79%	
ROSN	15 июн	23 072	1,02%	0	23 095	80	-58,97%	978	-12,05%	8,12	67%	8,97%	
SNGR	15 июн	24 310	-3,53%	0	24 850	183	-17,57%	840	-6,87%	0,41	-18%	4,22%	
SBPR	15 июн	6 445	-5,48%	6 441	6 927	38	137,50%	846	4,19%	0,45	325,00%	1,74%	

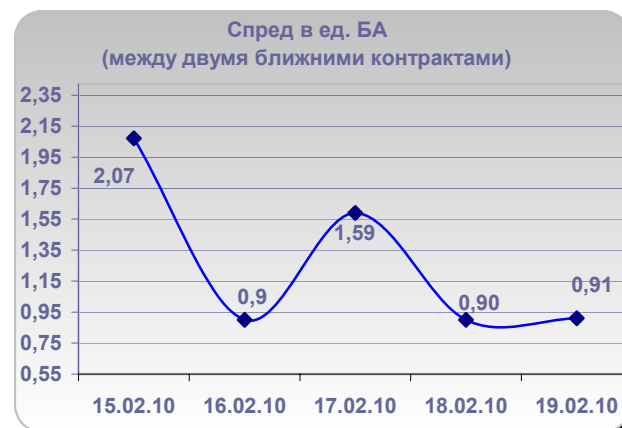
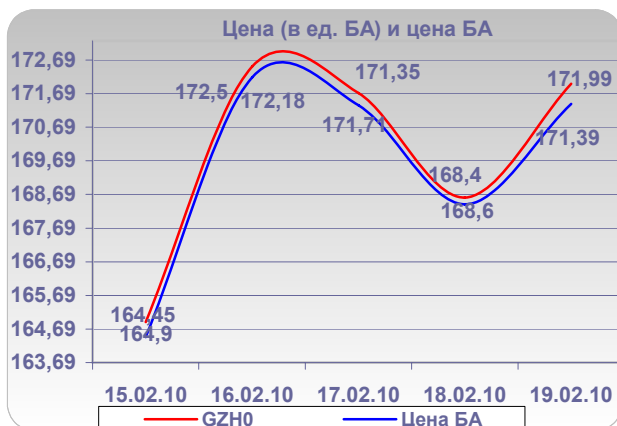
* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Динамика основных показателей

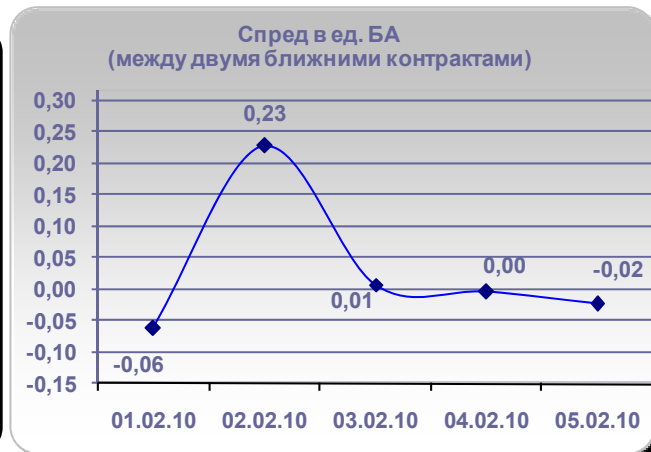
RTSI



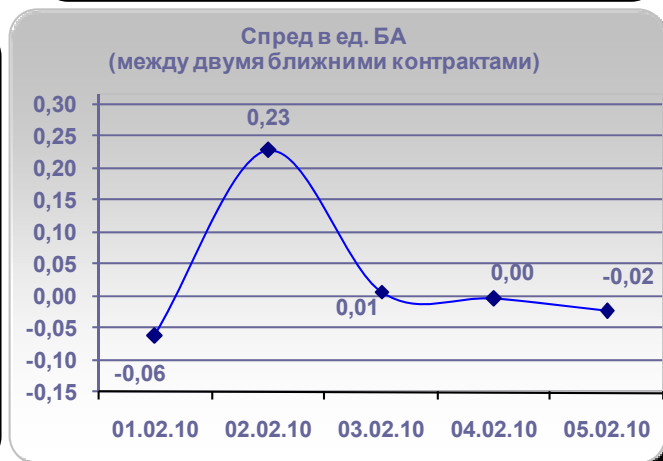
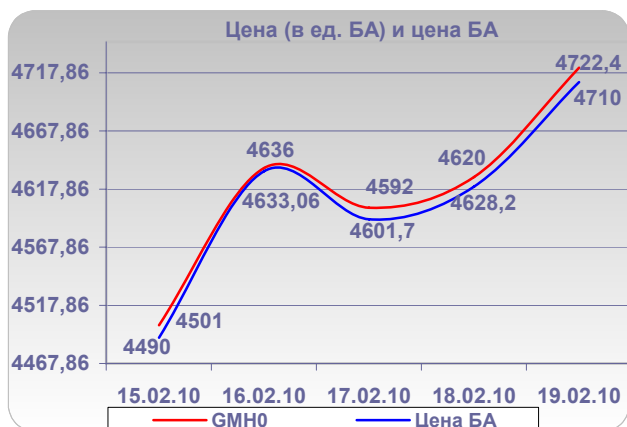
GAZR



LKOH



GMKR



SBRF

