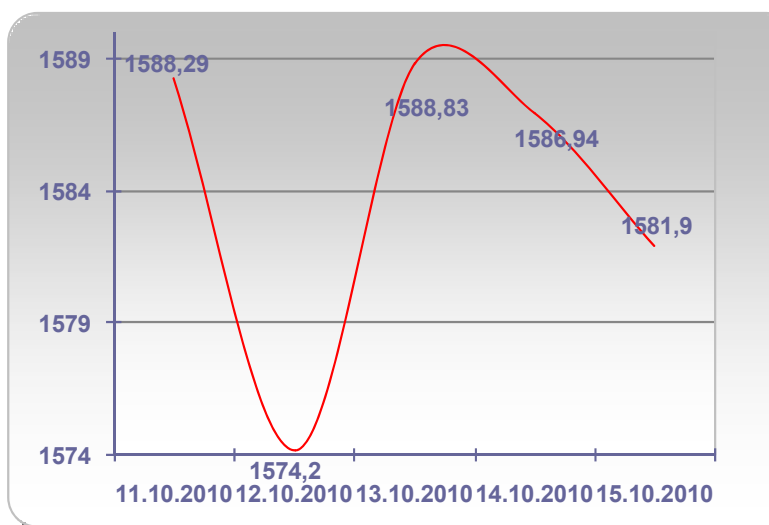


Еженедельный обзор российского рынка индексных деривативов и деривативов на акции

За 11 – 15 октября 2010 года



■ Индекс РТС:



■ Краткие итоги по ближним фьючерсам (декабрьские):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	30 100	0,43%	4 401 296	-6,63%	6 842	-16,50%
GAZR	16 162	-1,38%	747 316	-14,01%	764 358	5,08%
LKOH	17 934	3,44%	277 265	16,36%	189 514	12,80%
ROSN	6 595	3,56%	64 757	-10,76%	213 768	5,79%
GMKR	54 735	3,66%	28 670	4,45%	32 472	21,25%
SNGR	37 230	8,99%	3 872	18,48%	4 830	-7,54%
MTSI	24 961	-0,55%	428	-39,89%	1 216	6,11%
PLZL	15 800	4,29%	257	-0,77%	192	7,87%
RTSo	9 290	2,17%	110	587,50%	1 067 130	4,86%
RTSc	20 782	-0,14%	30	-16,67%	47 616	37,88%

В целом негативная неделя для российского рынка

На прошедшей неделе отечественные индексы на протяжении всей недели показывали разнонаправленные движения, показав в конце уверенное падение. Плохой фон создала нефть, совершив падение от 83,8\$/баррель до 81,29\$/баррель. Начало недели отметилось как негативом так и позитивом: в целом нейтральные данные по статистике и позитивная динамика торгов на европейских и азиатских фондовых рынках. Во второй половине недели негатив на рынки внесли данные по безработице, дальнейшее падение цен на нефть, уверенное падение фьючерсов на американские индексы. Индекс РТС в начале четверга пробил отметку 1600 пунктов, не закрепившись там и скорректировавшись к концу недели, завершив падение до отметки 1581,9 пунктов.

На рынке FORTS фьючерсы показали разнонаправленные движения. Базис фьючерсов на индекс РТС с поставкой в декабре по результатам недели попал в бэквордацию на 5,15 пункта. Ближние фьючерсы на об. акции Газпрома упали в цене на 1,38%, а фьючерсы на об. акции Сбербанка выросли в цене на 1,16%. Рыночная волатильность опционов «на деньгах» на фьючерсы на индекс РТС с исполнением в декабре составила 22,415 пункта.

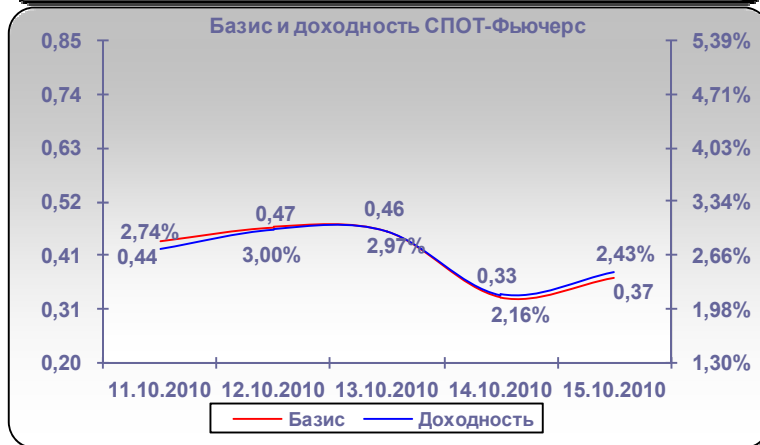
■ Фьючерсы: итоги торгов *

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	14 дек	54 735	3,66%	52 830	55 237	28 670	4,45%	32 472	21,25%	-18,50	25,70%	-1,78%
GAZR	14 дек	16 162	-1,38%	16 130	16 635	747 316	-14,01%	764 358	5,08%	0,62	16,98%	2,09%
LKOH	14 дек	17 934	3,44%	17 357	18 333	277 265	16,36%	189 514	12,80%	8,40	58,49%	2,55%
MTSI	14 дек	24 961	-0,55%	24 839	25 297	428	-39,89%	1 216	6,11%	-1,35	-497,06%	-2,62%
NVTK	14 дек	23 000	3,60%	0	23 215	12	-42,86%	62	47,62%	-5,70	32,94%	-11,80%
PLZL	14 дек	15 800	4,29%	15 008	16 198	257	-0,77%	192	7,87%	-26,99	-349,83%	-8,20%
RTSc	15 дек	20 782	-0,14%	0	299	30	-16,67%	47 616	37,88%	20431,25	-0,19%	3524,40%
RTSI	15 дек	30 100	0,43%	155 850	160 745	4 401 296	-6,63%	6 842	-16,50%	-49,75	-19,08%	-75,19%
ROSN	14 дек	6 595	3,56%	20 782	21 849	64 757	-10,76%	213 768	5,79%	-143,14	0,81%	-397,63%
RTSo	15 дек	9 290	2,17%	0	186	110	587,50%	1 067 130	4,86%	7708,10	2,42%	1709,56%
SNGR	14 дек	37 230	8,99%	29 751	30 800	3 872	18,48%	4 830	-7,54%	7,14	73,50%	121,81%

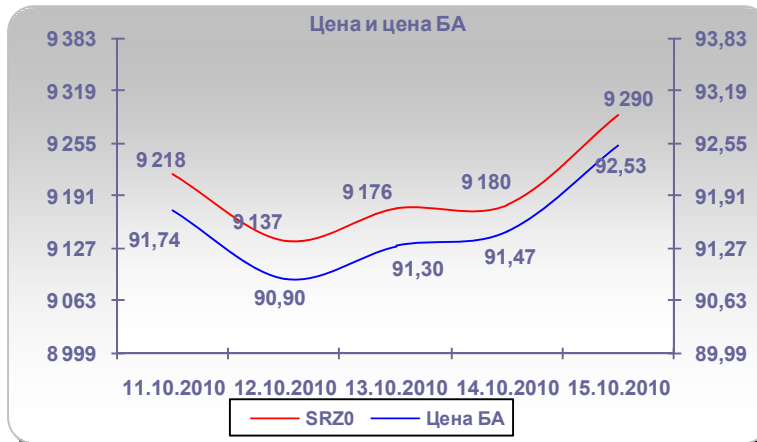
* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Динамика основных показателей

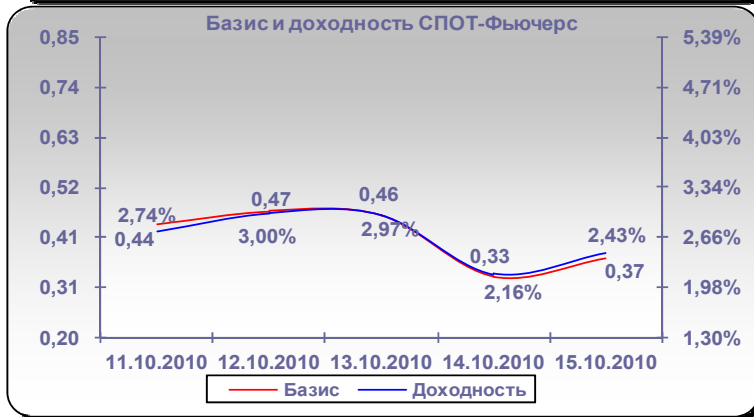
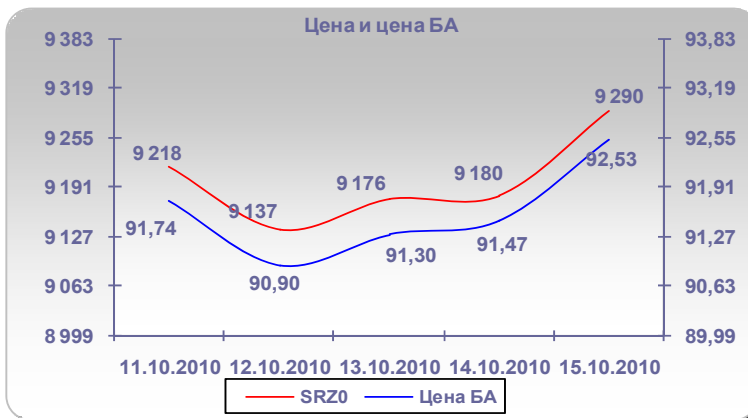
RTSI



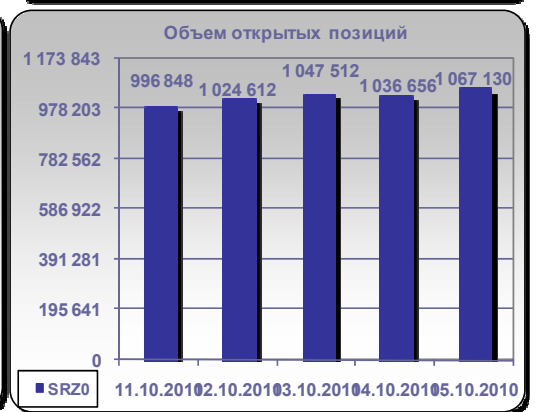
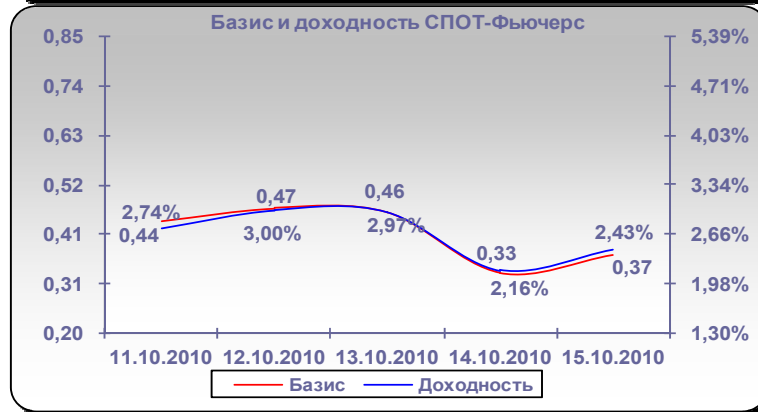
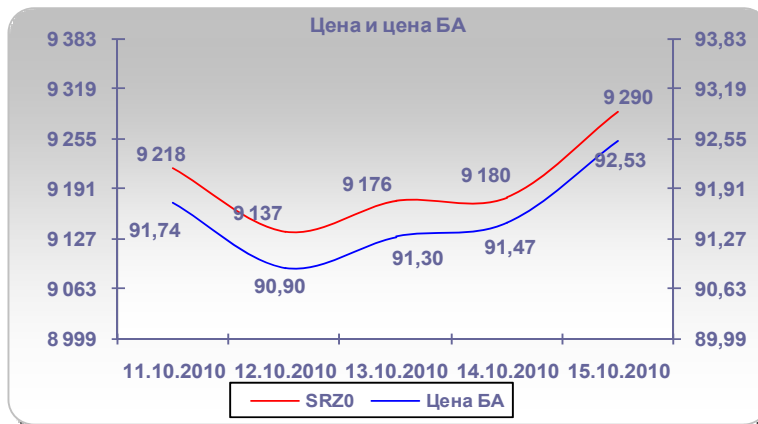
GAZR



ЛКОН



GMKR



SBRF

