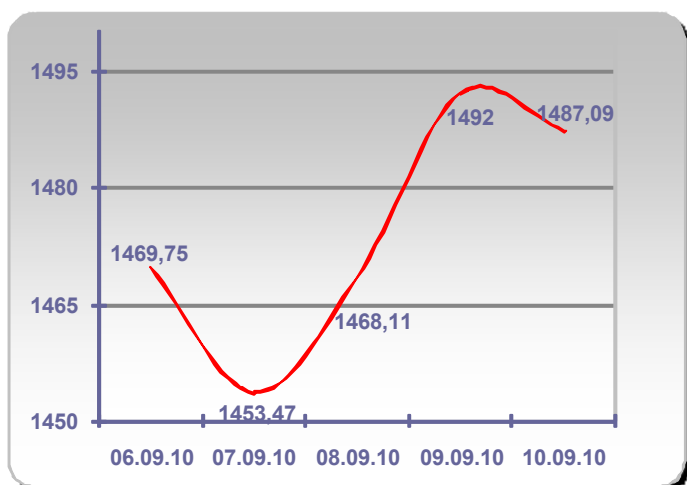


Еженедельный обзор российского рынка индексных деривативов и деривативов на акции

За 06 – 10 августа 2010 года



■ Индекс РТС:



■ Краткие итоги по ближним фьючерсам (июньские):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	149 100	1,40%	3 485 658	-16,26%	384 150	-17,65%
SBER	8 332	1,86%	2 251 503	-16,15%	1 250 356	-1,28%
GAZR	16 444	0,92%	649 079	-17,57%	344 428	-21,71%
LKOH	17 140	2,20%	142 287	-32,13%	130 482	-5,73%
SBPR	6 021	3,58%	89 959	81,04%	65 968	-55,70%
ROSN	20 602	1,65%	34 883	-14,81%	30 544	-17,86%
GMKR	51 793	-2,06%	30 591	-16,96%	16 864	1,09%
SNGR	30 655	1,22%	2 365	-20,02%	2 138	-41,84%
TRNF	34 050	3,30%	2 188	-72,44%	2 150	-28,95%
MTSI	25 444	2,77%	129	-44,40%	132	-23,26%

Позитивная неделя для российского рынка

На прошедшей неделе отечественные индексы на протяжении почти всей недели показывали уверенный рост, начиная со вторника. Нефть при этом находилась в восходящем тренде. Понедельник отметился скорее негативом, чем позитивом: в целом негативные данные по статистике и негативная динамика торгов на европейских, американских и азиатских фондовых рынках. Во второй половине недели позитив на рынки внесли в целом положительные статистические данные в мире, дальнейший рост цены на нефть, уверенный рост фьючерсов на американские индексы начиная со вторника. Индекс РТС в четверг взял отметку 1492 пункта, совершив рост с отметки в 1453,47 пункт.

На рынке FORTS большинство фьючерсов показали средний рост. Базис фьючерсов на индекс РТС с поставкой в сентябре по результатам недели попал в контанго на 3,97 пункта. Ближние фьючерсы на об. акции Газпрома и Сбербанка выросли в цене на 0,92 % и 1,86%. Рыночная волатильность опционов «на деньгах» на фьючерсы на индекс РТС с исполнением в сентябре незначительно выросла и составила 32,596 пункта.

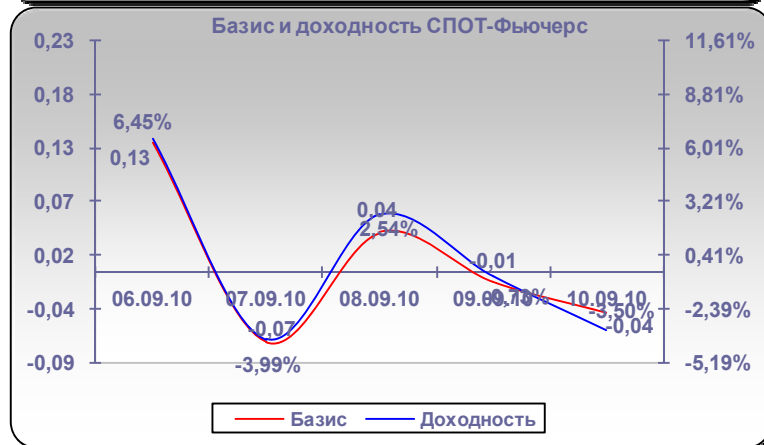
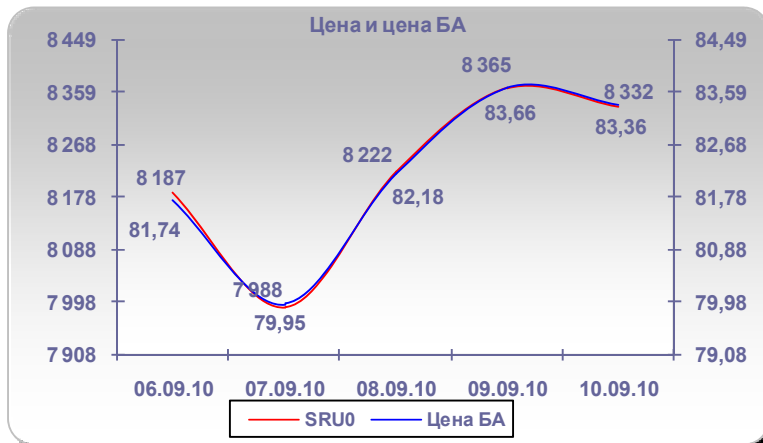
■ Фьючерсы: итоги торгов *

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 сен	51 793	-2,06%	51 341	53 666	30 591	-16,96%	16 864	1,09%	-29,58	-244,29%	-45,09%
GAZR	14 сен	16 444	0,92%	16 068	16 739	649 079	-17,57%	344 428	-21,71%	0,04	166,67%	1,98%
LKOH	14 сен	17 140	2,20%	16 557	17 245	142 287	-32,13%	130 482	-5,73%	1,00	-67,64%	4,76%
MTSI	14 сен	25 444	2,77%	24 800	25 561	129	-44,40%	132	-23,26%	-1,03	32,24%	-29,45%
PLZL	14 сен	14 001	-2,80%	14 001	14 599	110	-49,54%	544	1,87%	-9,95	-563,33%	-51,58%
RTSI	15 сен	149 100	1,40%	144 170	150 300	3 485 658	-16,26%	384 150	-17,65%	1166,26	1,35%	#####
ROSN	14 сен	20 602	1,65%	19 767	20 810	34 883	-14,81%	30 544	-17,86%	0,33	83,33%	12,73%
SNGR	14 сен	30 655	1,22%	29 835	30 900	2 365	-20,02%	2 138	-41,84%	-0,05	-125,00%	-13,96%
SBPR	15 сен	6 021	3,58%	5 658	6 166	89 959	81,04%	65 968	-55,70%	0,01	-66,67%	1,05%
SBER	15 сен	8 332	1,86%	7 933	8 455	2 251 503	-16,15%	1 250 356	-1,28%	-0,04	-150,00%	-3,13%
TRNF	15 сен	34 050	3,30%	32 300	34 579	2 188	-72,44%	2 150	-28,95%	-94,00	-8,06%	-17,48%
GMKR	14 дек	51 732	-1,96%	51 000	53 497	7 248	214,31%	8 500	146,52%	-35,68	-519,76%	-2,29%
GAZR	14 дек	16 555	1,01%	16 189	16 833	75 134	53,62%	135 864	94,92%	1,15	27,78%	2,35%
LKOH	14 дек	17 293	2,81%	16 652	17 312	17 349	17,56%	35 828	79,79%	16,30	104,01%	3,19%
RTSI	15 дек	148 620	632,80%	143 585	149 725	140 457	2151,64%	144 326	1417,30%	1161,46	1093,38%	1105,70%
ROSN	14 дек	20 676	-32,21%	19 908	20 809	12 088	2397,52%	21 376	2558,71%	1,07	-98,96%	1,74%
SNGR	14 дек	30 600	271,58%	29 905	31 285	407	-98,80%	1 242	-95,52%	-0,11	99,51%	-1,19%
SBPR	14 дек	6 125	-81,65%	5 750	6 237	42 972	15815,56%	70 576	19183,06%	1,05	-99,62%	5,81%

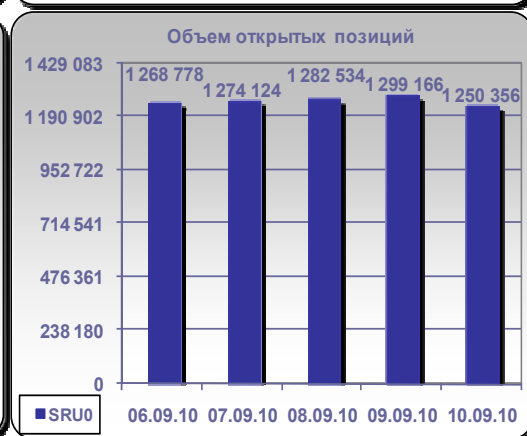
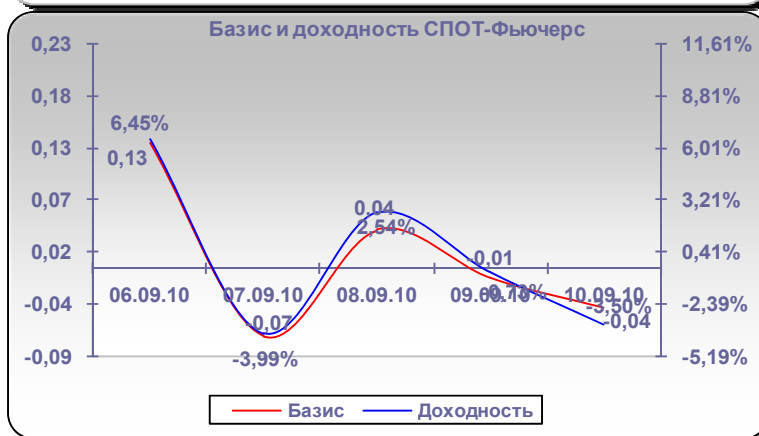
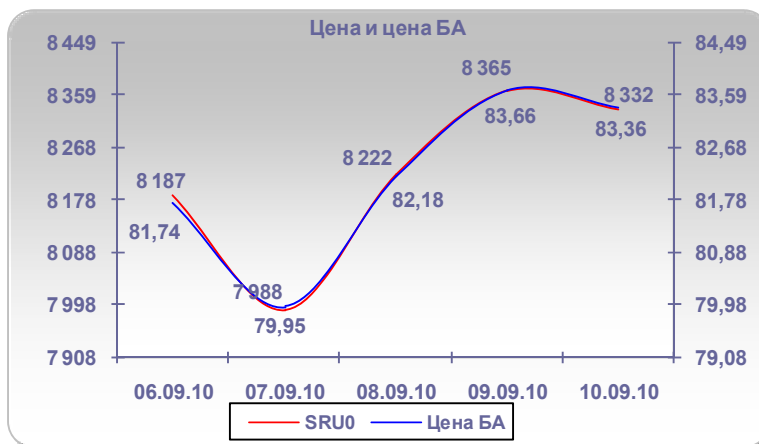
* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ **Динамика основных показателей**

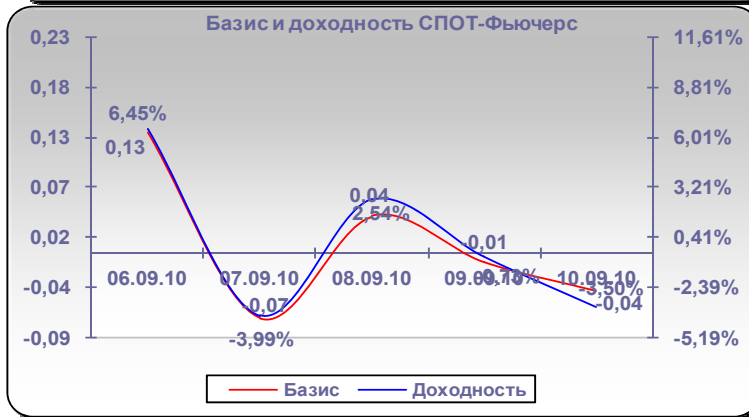
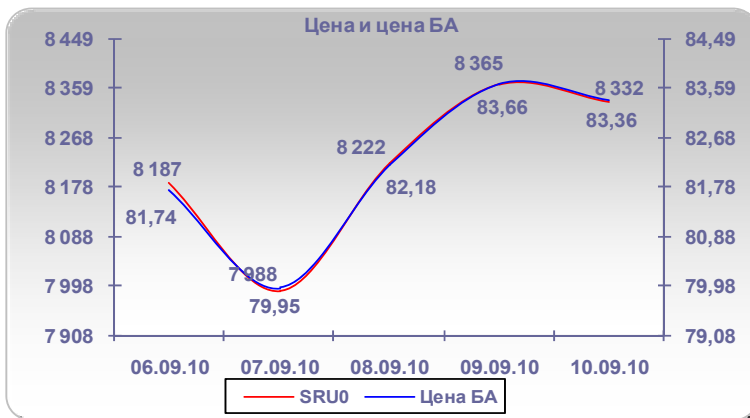
RTSI



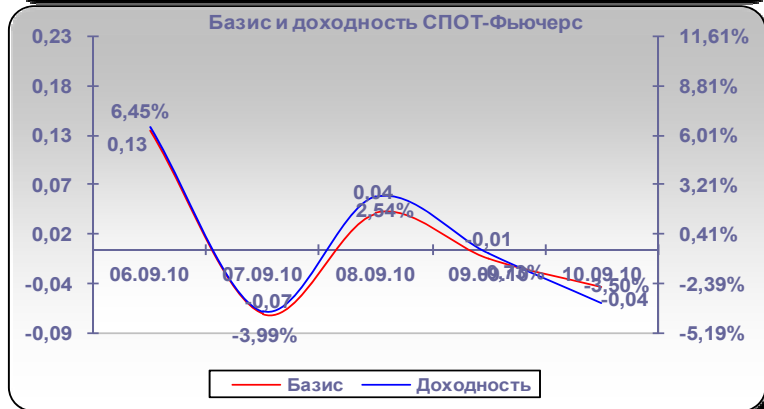
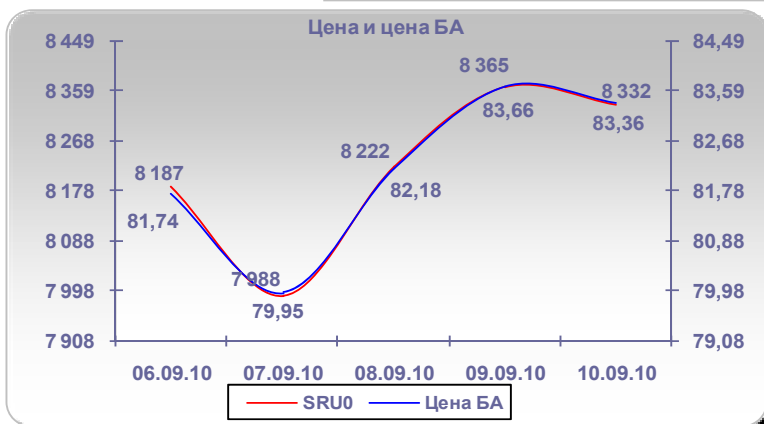
GAZR



LKOH



GMKR



SBRF

