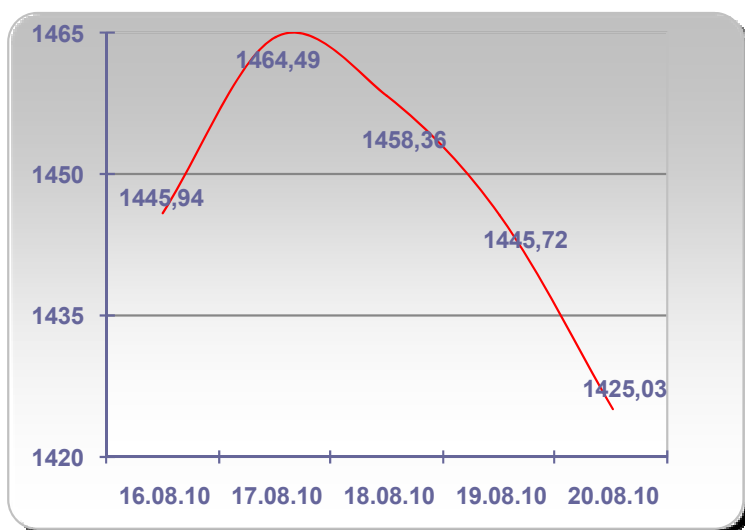


Еженедельный обзор российского рынка индексных деривативов и деривативов на акции

За 16 – 20 августа 2010 года



■ Индекс РТС:



■ Краткие итоги по ближним фьючерсам (июньские):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	142 025	-0,77%	4 127 826	-36,21%	490 644	3,36%
SBER	7 852	-3,06%	2 397 457	-31,41%	1 292 814	4,20%
GAZR	15 896	-1,62%	677 857	-39,96%	460 146	0,83%
LKOH	16 459	-0,41%	215 655	-34,31%	160 312	5,40%
SBPR	5 558	-4,60%	86 700	-35,12%	178 702	-2,97%
ROSN	20 007	0,12%	39 044	-27,55%	36 492	-4,42%
GMKR	51 810	3,37%	35 636	-27,91%	17 342	5,59%
TRNF	31 700	2,46%	3 635	-15,19%	3 368	-9,56%
SNGR	27 450	-5,04%	2 915	-39,86%	3 768	39,66%
PLZL	13 964	1,56%	347	-36,68%	420	-38,42%

Негативная неделя для российского рынка

На прошедшей неделе отечественные индексы на протяжении всей недели показывали уверенное падение, скорректировавшись от роста в начале. Плохой фон создала нефть, совершив падение от 77.3\$/баррель до 74,31\$/баррель. Начало недели отметилось как негативом так и позитивом: в целом положительные 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 середине недели взял отметку 1464 пункта, скорректировавшись к концу недели, завершив падение до отметки 1425 пунктов.

На рынке FORTS большинство фьючерсов показали среднее падение. Базис фьючерсов на индекс РТС с поставкой в сентябре по результатам недели попал в бэквордацию на 5,05 пункта. Ближние фьючерсы на об. акции Газпрома и Сбербанка упали в цене на 1,62 % и 3,06%. Рыночная волатильность опционов «на деньгах» на фьючерсы на индекс РТС с исполнением в сентябре незначительно снизилась и составила 25,8 пункта.

■ Фьючерсы: итоги торгов *

Derivative Expert
Телефон: (495) 981-53-81
Волков Денис

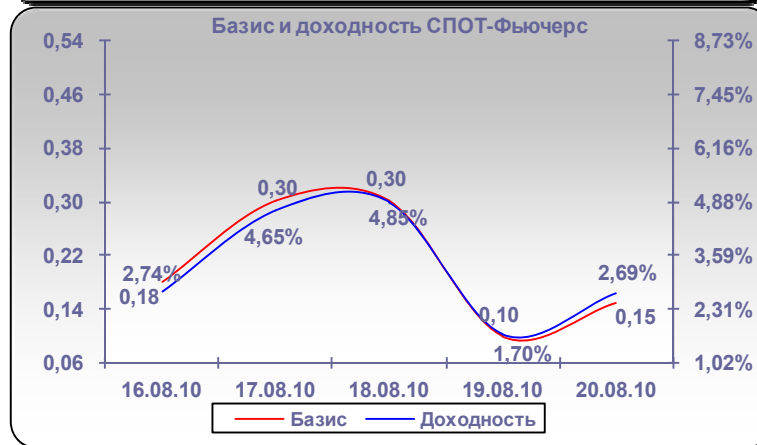
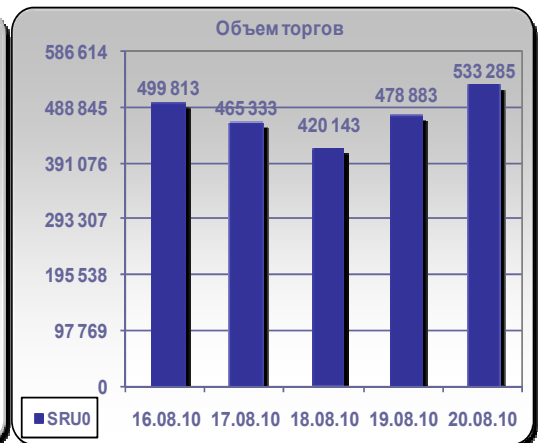
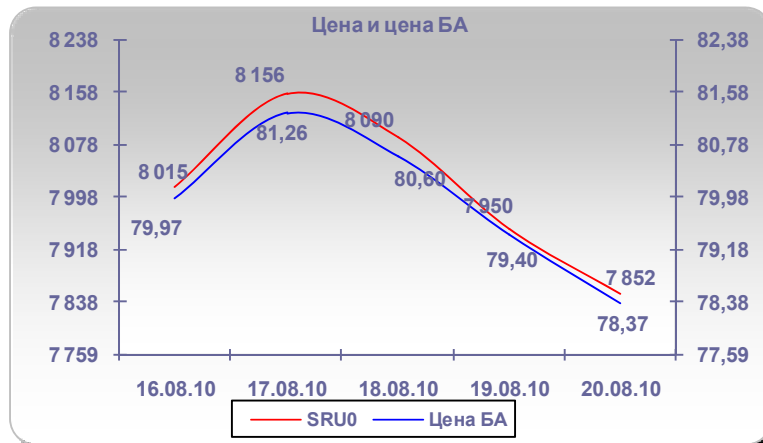
E-mail: info@derex.ru
<http://www.derex.ru>

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	51 810	3,37%	49 806	52 916	35 636	-27,91%	17 342	5,59%	11,00	450,00%	2,59%
GAZR	14 сен	15 896	-1,62%	15 806	16 549	677 857	-39,96%	460 146	0,83%	0,23	-28,12%	1,84%
LKOH	14 сен	16 459	-0,41%	16 219	16 765	215 655	-34,31%	160 312	5,40%	0,03	-98,85%	0,02%
MTSI	14 сен	24 390	0,07%	24 100	24 545	153	-70,06%	370	6,94%	-0,60	-372,73%	-2,76%
PLZL	14 сен	13 964	1,56%	13 706	14 489	347	-36,68%	420	-38,42%	6,40	15900,00%	5,17%
RTSI	15 сен	142 025	-0,77%	140 805	146 970	4 127 826	-36,21%	490 644	3,36%	1219,85	-0,92%	6319,81%
ROSN	14 сен	20 007	0,12%	19 704	20 440	39 044	-27,55%	36 492	-4,42%	-16,88	-50,71%	-95,91%
SNGR	14 сен	27 450	-5,04%	27 257	28 900	2 915	-39,86%	3 768	39,66%	-0,09	-143,90%	-3,98%
SBPR	15 сен	5 558	-4,60%	5 500	5 852	86 700	-35,12%	178 702	-2,97%	0,08	-73,33%	1,69%
SBER	15 сен	7 852	-3,06%	7 820	8 198	2 397 457	-31,41%	1 292 814	4,20%	0,15	-48,28%	2,34%
TRNF	15 сен	31 700	2,46%	28 900	32 000	3 635	-15,19%	3 368	-9,56%	49,96	-64,31%	1,85%
GMKR	14 дек	51 191	--	50 310	53 000	449	108,84%	638	7,05%	-50,90	98,98%	-2,58%
GAZR	14 дек	16 076	-1,68%	15 988	16 679	3 532	243,25%	6 416	57,25%	2,03	-9,37%	3,41%
RTSI	15 дек	142 000	-0,84%	140 870	146 875	2 520	85,98%	2 194	26,24%	1219,60	-1,01%	1404,11%
ROSN	14 дек	20 100	--	19 707	20 615	1 025	8441,67%	1 430	8,50%	-15,95	92,44%	-19,52%
SBER	14 дек	7 895	-2,17%	7 870	8 210	9 770	2,58%	8 832	89,53%	0,58	5900,00%	1,97%

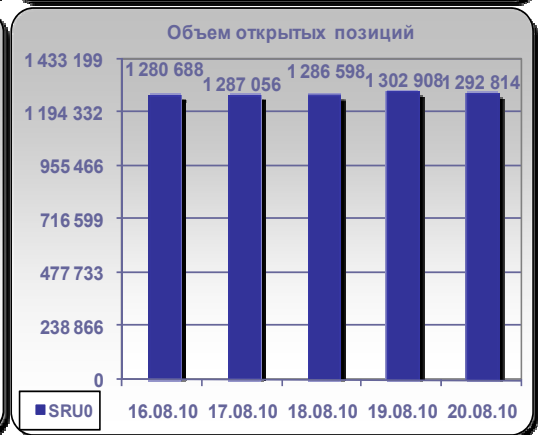
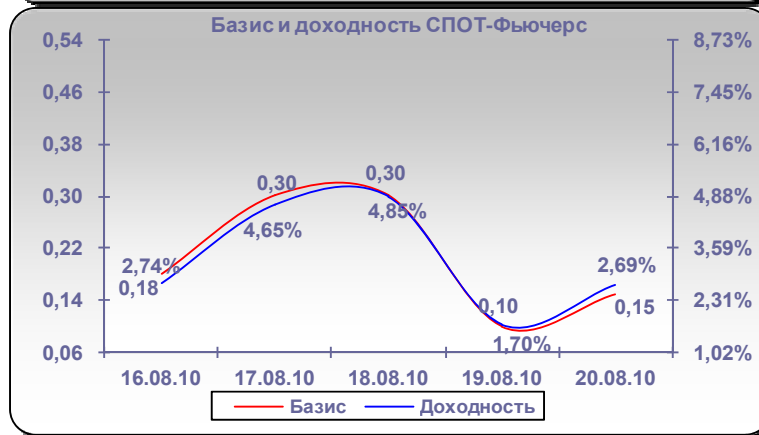
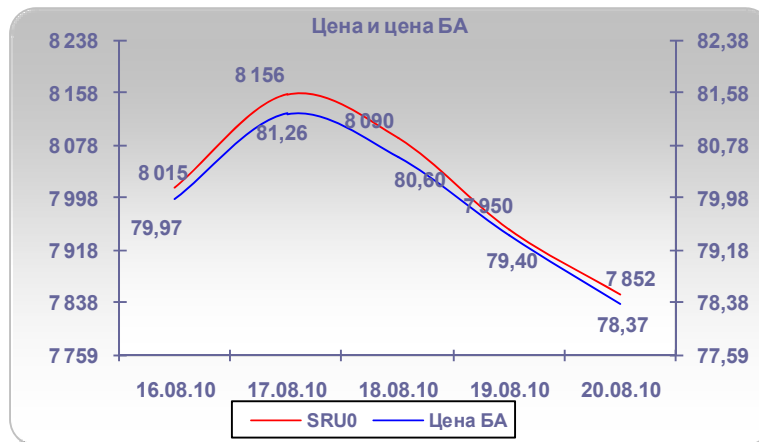
* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Динамика основных показателей

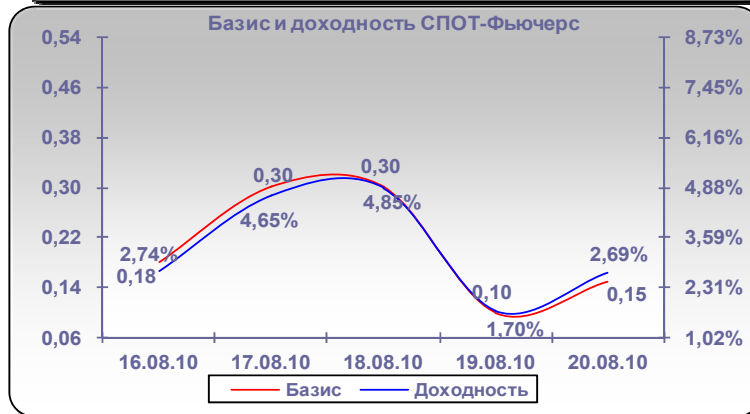
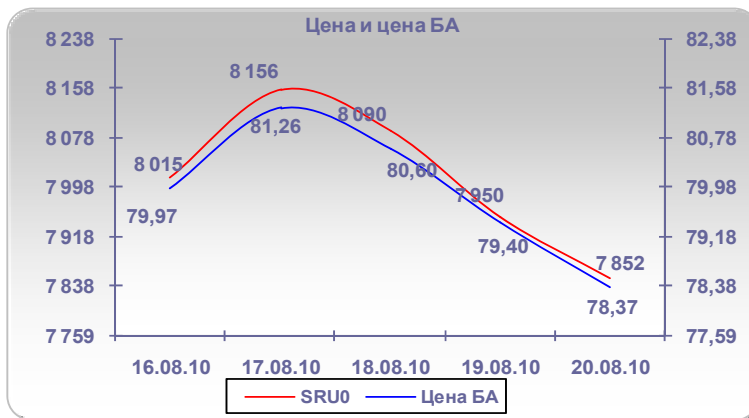
RTSI



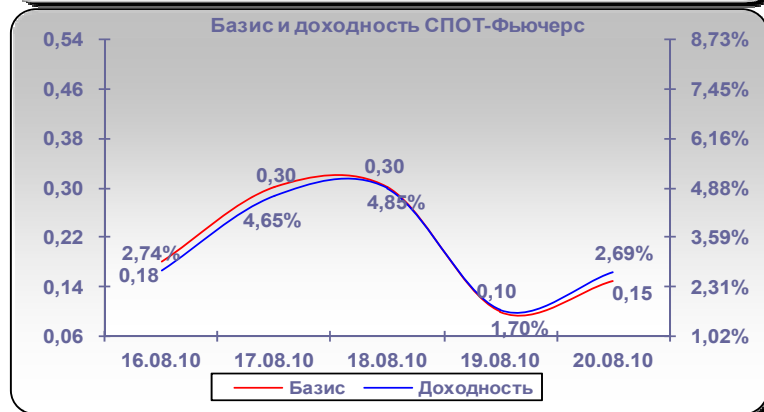
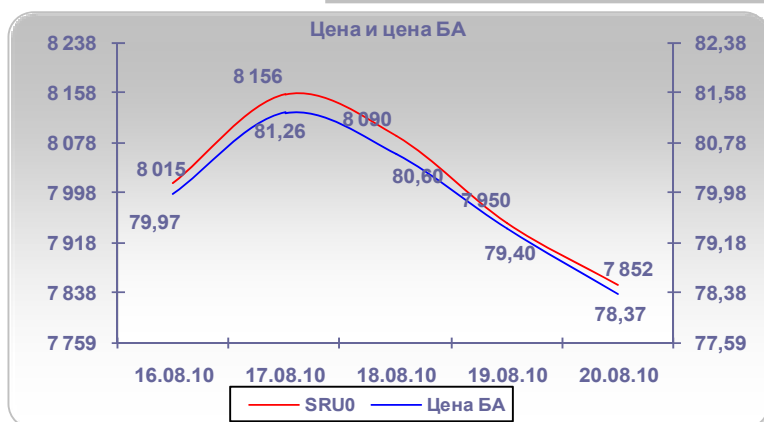
GAZR



ЛКОН



GMKR



SBRF

