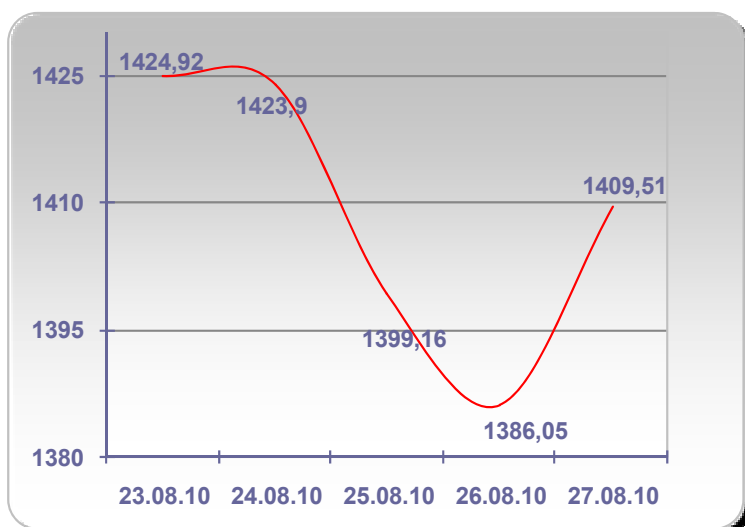


Еженедельный обзор российского рынка индексных деривативов и деривативов на акции

За 23 –27 августа 2010 года



■ Индекс РТС:



■ Краткие итоги по ближним фьючерсам (июньские):

Код БА	Цена	Изм-е	Объем	Изм-е	Откр.поз.	Изм-е
RTSI	141 375	-0,46%	4 751 180	15,10%	443 080	-9,69%
SBER	7 712	-1,78%	3 302 931	37,77%	1 336 902	3,41%
GAZR	15 866	-0,19%	783 033	15,52%	493 242	7,19%
LKOH	16 664	1,25%	200 548	-7,01%	159 700	-0,38%
SBPR	5 534	-0,43%	61 302	-29,29%	159 230	-10,90%
ROSN	19 700	-1,53%	34 660	-11,23%	43 736	19,85%
GMKR	52 030	0,42%	34 398	-3,47%	18 170	4,77%
TRNF	33 220	4,79%	7 239	99,15%	4 092	21,50%
SNGR	28 300	3,10%	3 325	14,07%	4 416	17,20%
MTSI	24 815	1,74%	277	81,05%	202	-45,41%

Негативная неделя для российского рынка

На прошедшей неделе отечественные индексы в начале недели показывали уверенное падение, скорректировавшись к концу недели, перейдя в уверенный рост. Плохой фон создала нефть, совершив падение от 74.3\$/баррель до 72,1 \$/баррель, показав рост к концу недели до 77,1 \$/баррель. Начало недели информационно отмечилось негативом: в целом положительные данные по статистике и негативная динамика торгов на европейских и азиатских фондовых рынках. Во второй половине недели позитив на рынки внесли данные по росту ВВП США, рост цен на нефть, уверенный рост фьючерсов на американские индексы. Индекс РТС к концу недели взял отметку 1409 пунктов, упав в четверг до 1386,05 пунктов.

На рынке FORTS большинство фьючерсов показали среднее падение. Базис фьючерсов на индекс РТС с поставкой в сентябре по результатам недели попал в контанго на 25,5 пункта. Ближние фьючерсы на об. акции Газпрома и Сбербанка упали в цене на 0,19 % и 1,78 %. Рыночная волатильность опционов «на деньгах» на фьючерсы на индекс РТС с исполнением в сентябре незначительно увеличилась и составила 38,8 пункта.

■ Фьючерсы: итоги торгов *

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

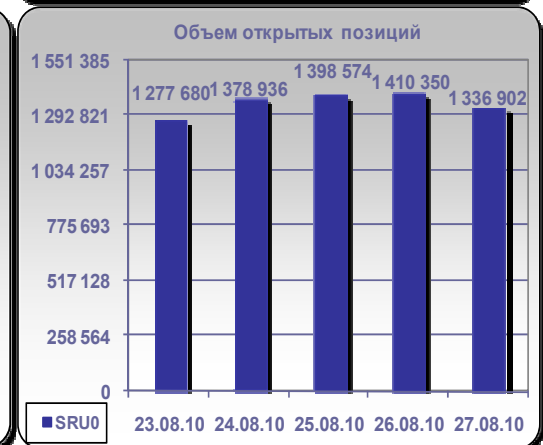
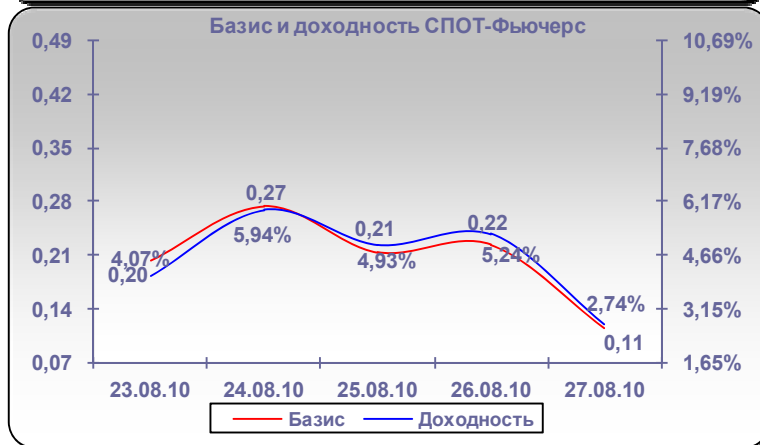
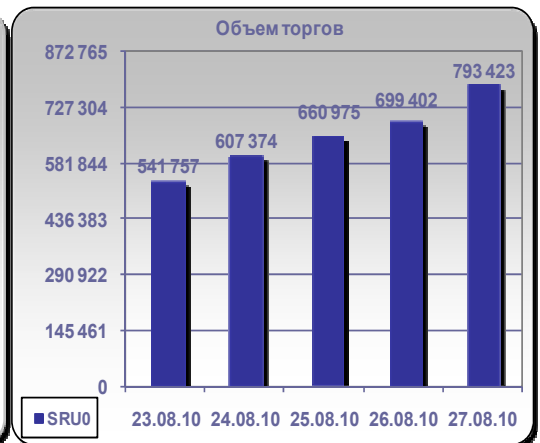
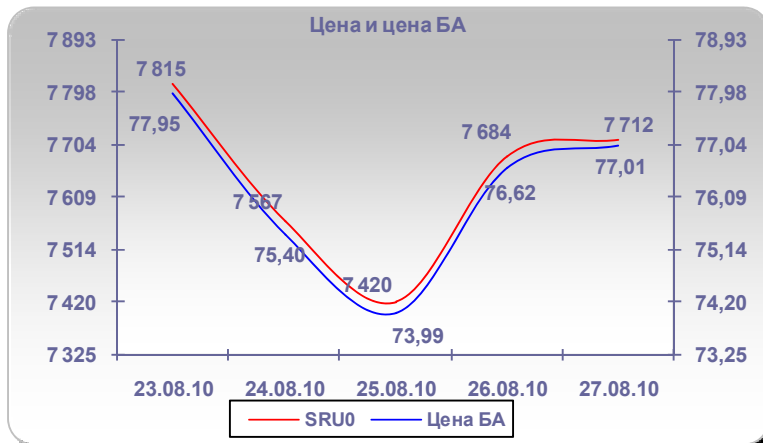
E-mail: info@derex.ru
<http://www.derex.ru>

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	52 030	0,42%	49 935	52 251	34 398	-3,47%	18 170	4,77%	5,00	-54,55%	1,63%
GAZR	14 сен	15 866	-0,19%	15 505	16 034	783 033	15,52%	493 242	7,19%	0,10	-56,52%	1,11%
LKOH	14 сен	16 664	1,25%	16 230	16 743	200 548	-7,01%	159 700	-0,38%	-1,60	-5433,33%	-1,69%
MTSI	14 сен	24 815	1,74%	24 405	24 844	277	81,05%	202	-45,41%	0,15	125,00%	0,94%
PLZL	14 сен	13 900	-0,46%	13 501	13 924	86	-75,22%	410	-2,38%	0,07	-98,91%	0,08%
RTSI	15 сен	141 375	-0,46%	136 740	142 970	4 751 180	15,10%	443 080	-9,69%	1216,75	-0,25%	8739,52%
ROSN	14 сен	19 700	-1,53%	19 281	20 249	34 660	-11,23%	43 736	19,85%	0,00	100,00%	0,00%
SNGR	14 сен	28 300	3,10%	27 052	28 338	3 325	14,07%	4 416	17,20%	-0,04	57,78%	-2,27%
SBPR	15 сен	5 534	-0,43%	5 300	5 620	61 302	-29,29%	159 230	-10,90%	0,12	50,00%	3,48%
SBER	15 сен	7 712	-1,78%	7 375	7 912	3 302 931	37,77%	1 336 902	3,41%	0,11	-26,67%	2,38%
TRNF	15 сен	33 220	4,79%	31 220	34 350	7 239	99,15%	4 092	21,50%	-120,00	-340,19%	-5,76%
GAZR	14 дек	16 031	-0,28%	15 668	16 416	5 782	63,70%	11 516	79,49%	1,75	-13,79%	3,13%
LKOH	14 дек	16 782	1,42%	16 302	16 898	2 013	1,16%	3 214	29,39%	10,20	15,52%	1,74%
RTSI	15 дек	141 440	-0,39%	136 610	142 950	19 994	693,41%	44 258	1917,23%	1217,40	-0,18%	1510,36%
ROSN	14 дек	19 690	-2,04%	19 401	21 400	1 172	14,34%	1 648	15,24%	-0,10	99,37%	-0,14%
SNGR	14 дек	28 300	3,10%	27 300	29 900	186	41,98%	672	23,53%	-0,04	57,78%	-0,37%
SBPR	14 дек	5 555	-2,29%	5 400	5 822	2 855	491,10%	5 386	184,07%	0,33	-75,56%	1,67%
SBER	14 дек	7 779	-1,47%	7 451	7 980	23 035	135,77%	15 510	75,61%	0,78	34,48%	2,87%
TRNF	14 дек	33 400	5,36%	31 650	34 000	19	375,00%	24	50,00%	60,00	20,10%	0,50%

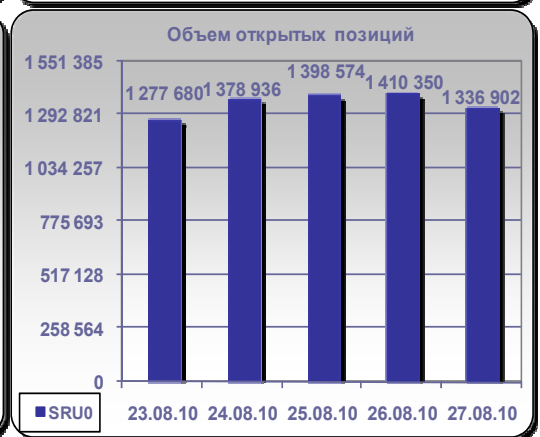
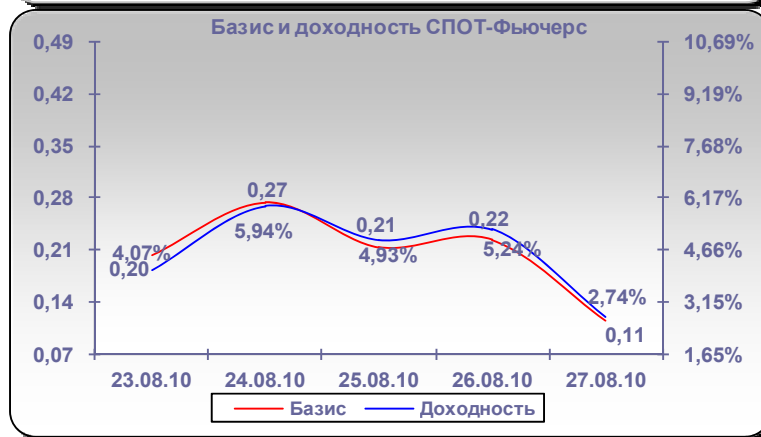
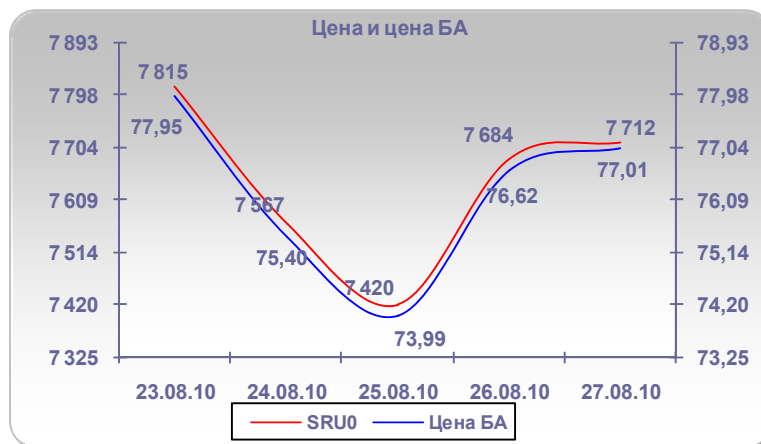
* Доходность спот-фьючерс с учетом ГО

■ Динамика основных показателей

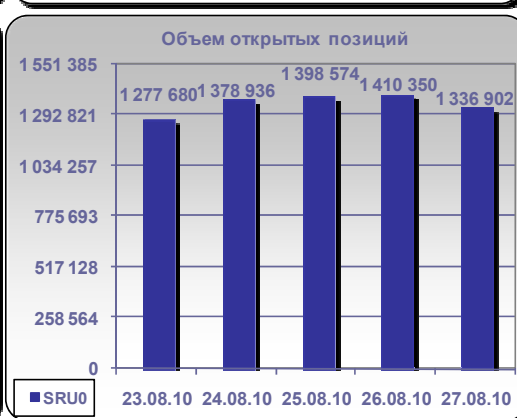
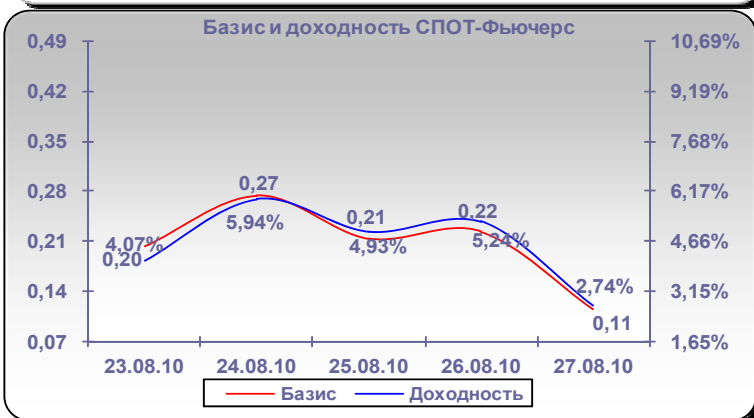
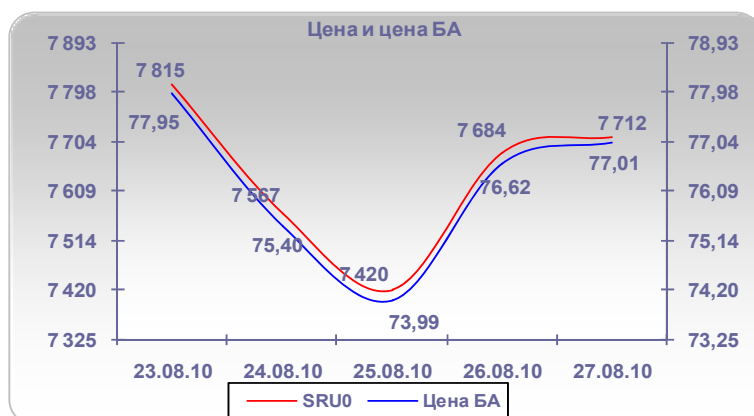
RTSI



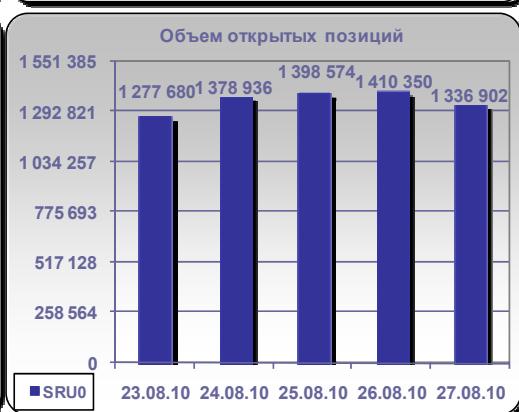
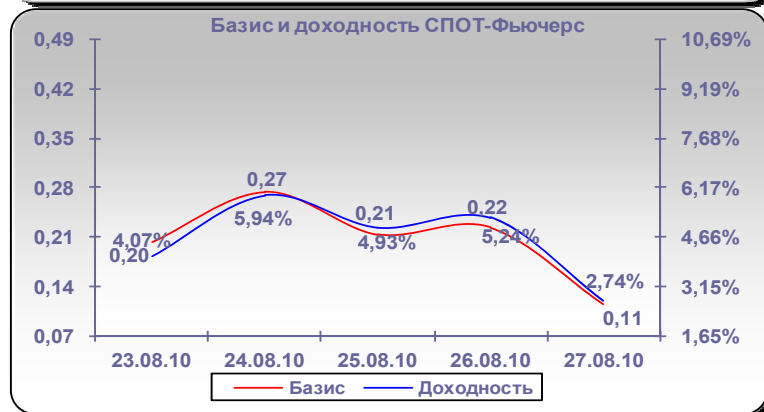
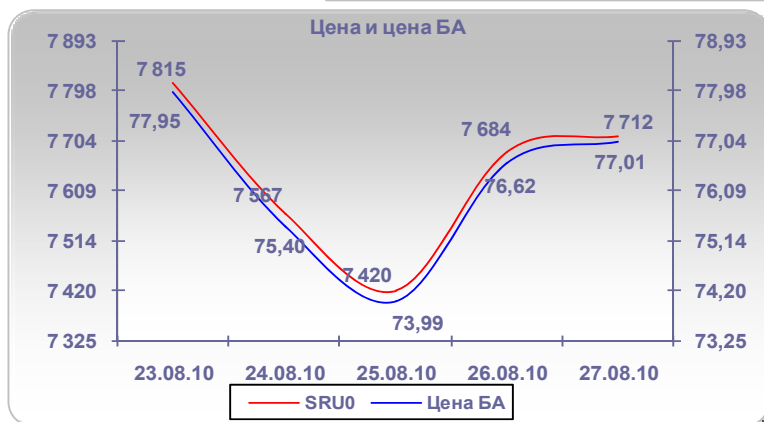
GAZR



ЛКОН



GMKR



SBRF

