

Фьючерсы на акции российских и иностранных эмитентов

<https://www.moex.com/ru/derivatives/equity/stocks/>

- Скачать базу данных с сайта finam.ru. Выбрать акции в зависимости от варианта. Старая версия сайта. Далее выбрать «Экспорт котировок».
- Задать следующие параметры:
 - Интервал и периодичность: с 01.09.2021 по 31.12.2021
 - Периодичность: 1 день
 - Выдавать время: окончание свечи
 - Разделитель полей: точка с запятой
 - Разделитель разрядов: запятая
 - Формат записи: ticker, per, date, time, open, high, low, close, vol

Таблица 1. Общие характеристики

Тип контракта	Поставочный
Месяцы исполнения	Март, Июнь, Сентябрь, Декабрь
Цена контракта	В рублях за 1 контракт
Шаг цены	1 рубль за 1 контракт
Последний день обращения	3 четверг месяца и года исполнения Контракта
Исполнение Контракта	Первый торговый день, в который проводятся торги Акциями на фондовом рынке , после последнего дня заключения Контракта
Расписание торгов	10:00 - 18:45 МСК – основная торговая сессия 19:00 - 23:50 МСК – дополнительная вечерняя сессия <u>2 клиринговые сессии:</u> 14:00-14:05 – промежуточная клиринговая сессия 18:45-19:00 – вечерняя клиринговая сессия

Варианты соответствуют списку группы, фьючерсы для каждого варианта соответствуют списку фьючерсов из таблицы 2.

Таблица 2. Соответствие названий акций и фьючерсов:

Базовый актив	Объем контракта	Код контракта	Краткий код контракта в биржевой торговой системе	Код контракта в системе Reuters	Код контракта в системе Bloomberg
Обыкновенные акции ПАО "РусГидро"	10 000	HYDR	HY	HYDA Index	HYRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "ФСК ЕЭС"	100 000	FEES	FS	FEES=A RU Equity	FSRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Газпром"	100	GAZR	GZ	PZAA Index	GZRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "НК "Роснефть"	100	ROSN	RN	ROSA Index	RNRTSc1
Обыкновенные акции ПАО Сбербанк	100	SBRF	SR	SBSA Index	SRRTSc1
Привилегированные акции ПАО Сбербанк	100	SBPR	SP	SBER=A RU Equity	SPRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "НК "ЛУКОЙЛ"	10	LKOH	LK	LKOA Index	LKRTSc1

Обыкновенные акции ПАО "Ростелеком"	100	RTKM	RT	RTKM Index	RTRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Сургутнефтегаз"	1000	SNGR	SN	SGSA Index	SNRTSc1
Привилегированные акции ПАО "Сургутнефтегаз"	1000	SNGP	SG	SNGP=A RU Equity	SGRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "ГМК "Норильский никель"	10	GMKR	GM	MMCA Index	GMRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина	100	TATN	TT	TNTA Index	TTRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "МТС"	100	MTSI	MT	MTSA Index	MTRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "НОВАТЭК"	100	NOTK	NK	TECA Index	NKRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Северсталь"	100	CHMF	CH	SVLA Index	CHRTSc1
Привилегированные акции ПАО "Транснефть"	1	TRNF	TN	TRPA Index	TNRTSc1
Обыкновенные акции Банк ВТБ (ПАО)	100 000	VTBR	VB	VTBA Index	VBRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Уралкалий"	100	URKA	UK	URKA=A RU Equity	UKRTSc1
Обыкновенные акции ПАО Московская Биржа	100	MOEX	ME	MOEX=A RU Equity	0#MERTS
Обыкновенные акции ПАО "Магнит"	1	MGNT	MN	MGNT=A RU Equity	0#MNRTS
Обыкновенные акции ПАО "НЛМК"	100	NLMK	NM	NLMK=A RU Equity	NMRTSc1
Обыкновенные акции АК "АЛРОСА" (ПАО)	100	ALRS	AL	ALRS=A RU Equity	ALRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Аэрофлот"	100	AFLT	AF	AFLT=A RU Equity	AFRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Магнитогорский металлургический комбинат"	1 000	MAGN	MG		MNRTSc1
Обыкновенные акции ПАО "Полус"	10	PLZL	PZ		PZRTSc1

1. На сайте мос. биржи <https://www.moex.com/s126> нажать **Инструменты**, выбрать период с 01.09.21 по 31.12.21.
2. Выбрать фьючерсный контракт.
3. Спецификация, показать график.
4. Разобраться сколько акций приходится на 1 фьючерс. Какова дата экспирации.
5. Купить столько же акций, сколько приходится на 1 фьючерс (finam.ru), и открыть 1 фьючерс на продажу. Гарантийное обеспечение – 15%.
6. Войти, когда фьючерс дороже акций.
7. Продать акции и купить фьючерс за день до экспирации (фьючерс закрылся). Прибыль разница в ценах фьючерса и акций (если стоимость фьючерса меньше стоимости акций (редко, но бывает), то акции продавать, а фьючерс покупать, если есть акции, или шортиться – занимать у брокера. Бесплатные БД фьючерсов на мос. бирже только на большие периоды, и на фьючерсы поставочные).



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

воскресенье, 24.01.2021 00:36



Скрыть график

+ Добавить индикатор

Минута

10 Минут

Час

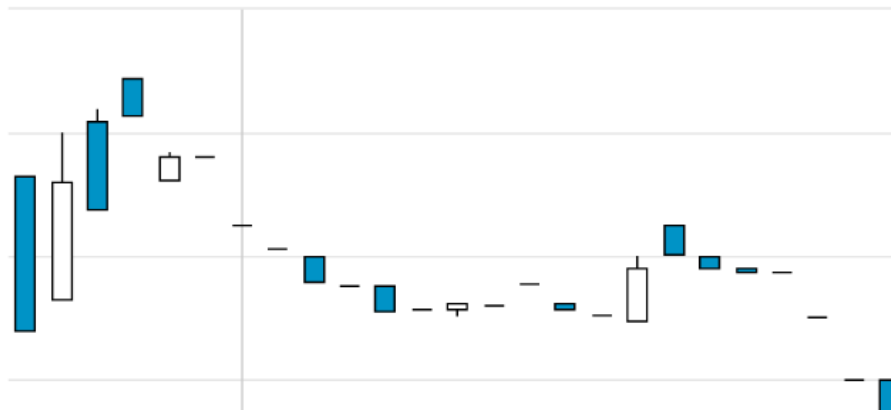
День

Неделя

Месяц

Квартал

23-01-2020 **GZZO** : Открытие: 24 514, Макс.: 24 514, Мин.: 24 514, Закрытие: 24 514, Объем: 1



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

суббота, 23.01.2021 23:03



Поиск

Фьючерсный контракт на обыкновенные акции ПАО «Газпром»

GAZR-12.20

Смотрите также



Скрыть график

+ Добавить индикатор

Минута

10 Минут

Час

День

Неделя

Месяц

Квартал



17-12-2020 **GZZO** : Открытие: 20 551, Макс.: 21 542, Мин.: 20 517, Закрытие: 21 496, Объем: 119 199

