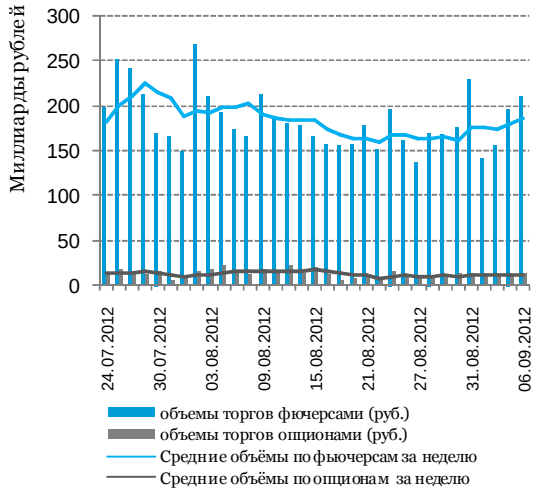
Объемы торгов фьючерсами и опционами на ФОРТС



Российский индекс волатильности RTSVX и фьючерс на него

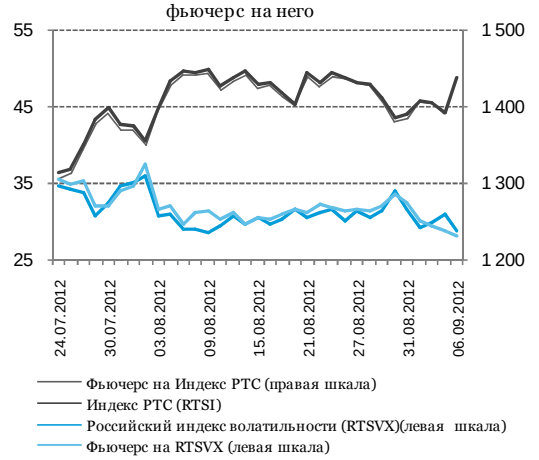


ГРАФИК ДНЯ

Открытый интерес во фьючерсах Сбербанка



РОСТ КОТИРОВОК НА ФОРТС С НАРАЩИВАНИЕМ ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ

Четверг ознаменовался бурным ростом котировок на срочном рынке. Повышение котировок проходило при высокой активности участников торгов и сопровождалось активным наращиванием открытых позиций. Суммарные обороты во фьючерсах и опционах составили 223 млрд руб при средних значениях 195 млрд. Индекс РТС взлетел на 3,33% (1437,37). Фьючерс на него прибавил 3,48% (1 438,4). Бэквордация -0,1% перешла в контанго +0.04%, что свидетельствует о росте оптимизма у участников торгов. Восходящая динамика контрактов на РТС была подкреплена агрессивным набором позиций (+7%). В сентябрьских опционах участники продавали коллы на 1 300 – 1 450, 1 550, 1 650 страйках. Суммарная позиция на этих уровнях снизилась на 17 000 контрактов, а подразумеваемая волатильность просела сразу на 1,7 – 4,3%. В путах наблюдалось закрытие позиций на далеких страйках в преддверии экспирации. Суммарная позиция на 1 200 – 1 350 страйках сократилась на 7 300 контрактов. Также следует отметить прирост позиций в путах на 1 400 – 1 450 страйках (+10 600 контрактов). В октябрьских опционах участники торгов покупали путы на широком диапазоне страйков. На 950 - 1 400 уровнях суммарная позиция выросла на 4 300 контрактов. Волатильность поднялась на 0,5 – 1,0%. В коллах рост позиций на 1 500 – 1 550 страйках (+2 000 контратктов) проходил на фоне просадки улыбки волатильности на 1,0 – 2,0%.

Индекс волатильности RTSVX обвалился на 7,02%, закрыв торговую сессию на отметке 28,72. Фьючерс на волатильность просел слабее (-1,91%; 28,2). Индекс VIX, показал рекордную просадку (-12,06%; 15,60). Разница между RTSVX и VIX сузилась до 13,1 пунктов.

Во фьючерсах на акции наблюдалась активные покупки по всему спектру ликвидных инструментов. Нефтегазовый сектор закрыл сессию на уровне рынка. Контракты Газпрома прибавили 2,54% (159,37). Интерес вырос меньше процента, базис расширился с 0,25% до 0,30%. Фьючерсы Лукойла показали более сдержанный рост (+1,65%; 1891,5). Участники торгов активно набирали позиции (+2%). Внушительный рост контрактов Норильского никеля (+2,71%; 4892) был обусловлен закрытием коротких позиций (-2%). Расширение базиса свидетельствует о более агрессивных покупках фьючерсов, чем базового актива. Контракты Сбербанка прибавили 1,23% (94,15), базис расширился до 0,21%. Рост котировок сопровождался активным наращиванием позиций (+3%). Контракты ВТБ оказались в лидерах роста (+3,68%; 5470) за счет закрытия коротких позиций. Интерес снизился на 1%. Базис расширился до 0,37%.

Резкое укрепление рубля к доллару США оказало поддержку всему рынку. Фьючерсы на эту валютную пару потеряли 1,0% (32,05). Участники торгов нервно избавлялись от хеджирующих позиций (-5%). Пара евро-доллар продемонстрировала умеренный рост котировок на высоких объемах (+0,21; 1,2620). Число открытых позиций увеличилось на 7%.

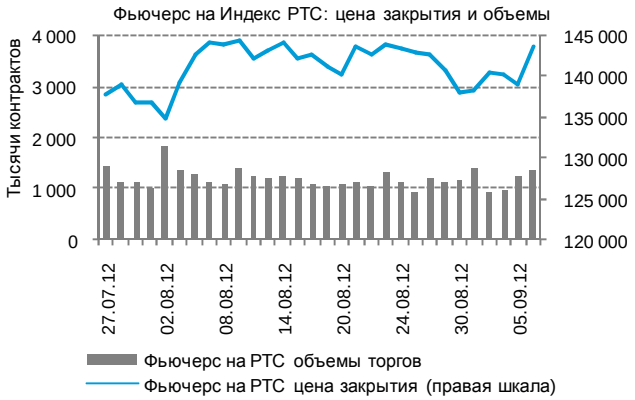
Драгоценные металлы продолжили ралли с обновлением локальных максимумов. Золото дорожало шестую сессию подряд (+0,86%; $1 709), движение проходило на высоких объемах без заметного изменения открытых позиций. Серебро прибавило 1,89% ($32,86). При этом интерес просел на 6%. Фьючерсы на нефть марки Brent вернулись к уровням вторника (+1,32%; $114,8). Игроки набирали позиции в черном золоте (+4%).

В вечернюю торговую сессию на ФОРТС фьючерс РТС остался на прежнем уровне. S&P500 обновил годовые максимумы. S&P500 (+2,04%; 1432,12), DOW (+1,87%; 13 292).

Перед открытием торгов на российских площадках, фьючерсы S&P500 прибавляют 0,05%, пара евро-доллар не меняется в цене (1.2631). Brent (+0.17%; $112,78), WTI (+0,01%; $94,73). Мы ожидаем открытия срочного рынка на уровнях вечерней сессии.

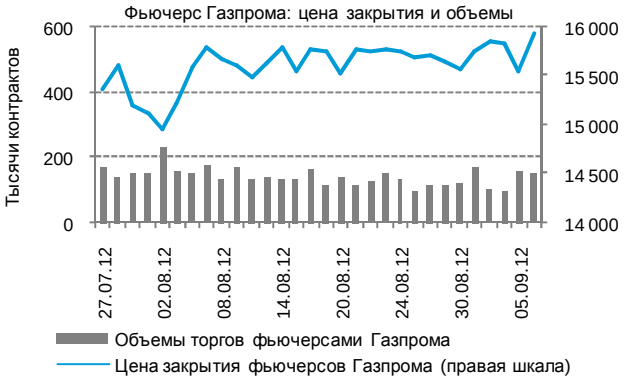
ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ»

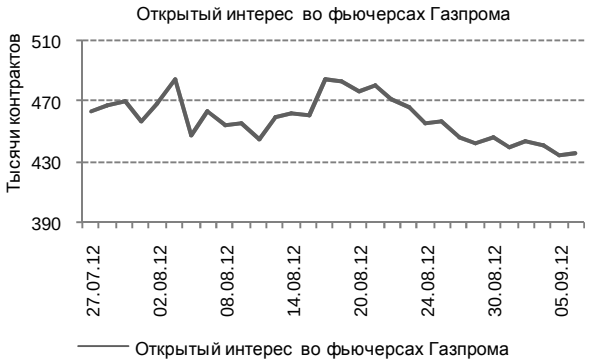
ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС



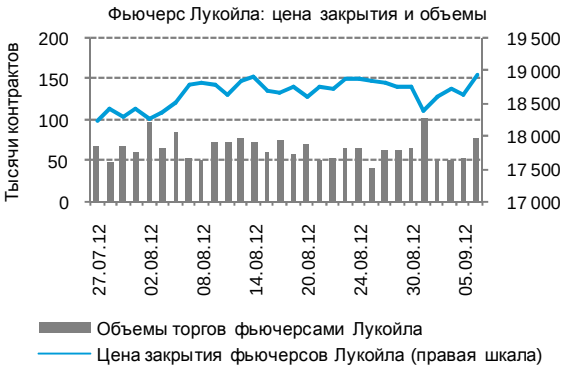


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



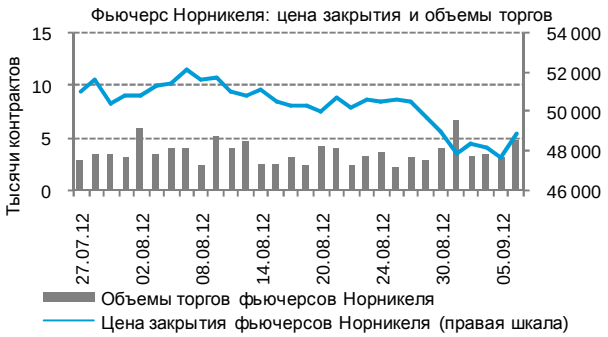


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА



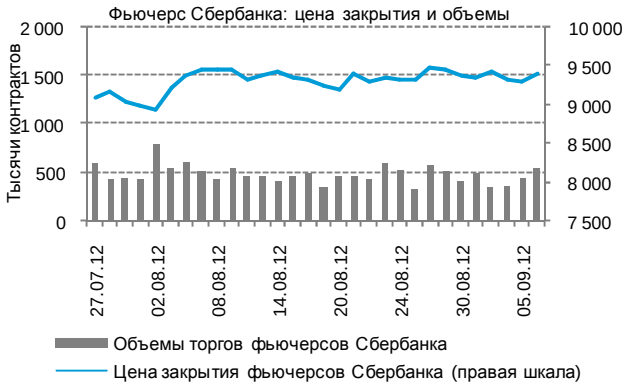


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК «НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ»



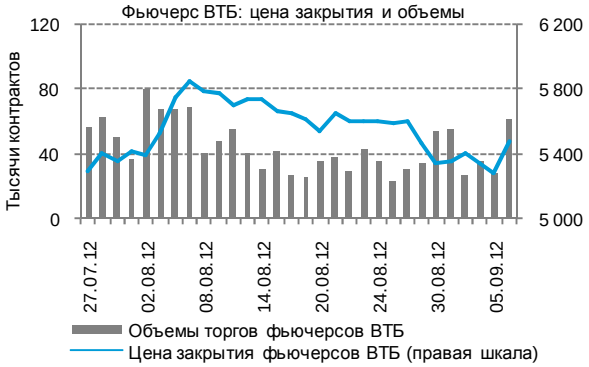


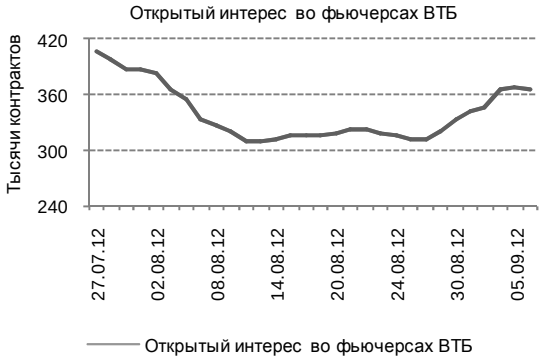
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА



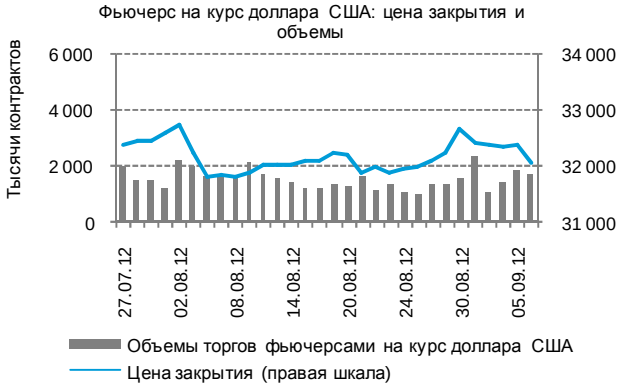


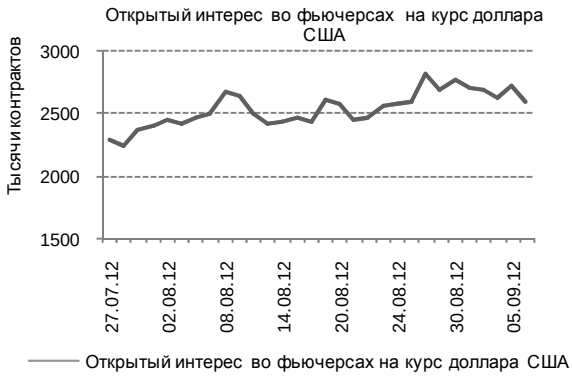
ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ



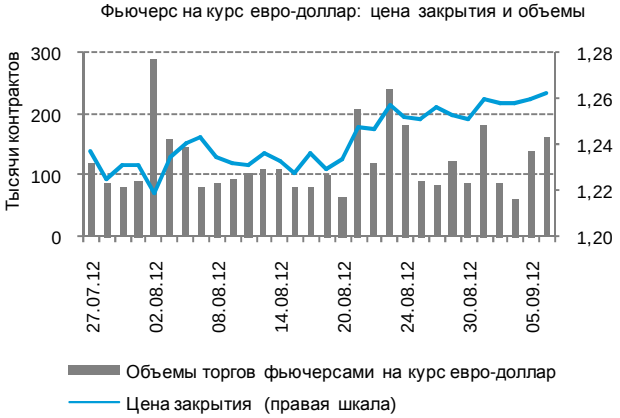


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ДОЛЛАРА США



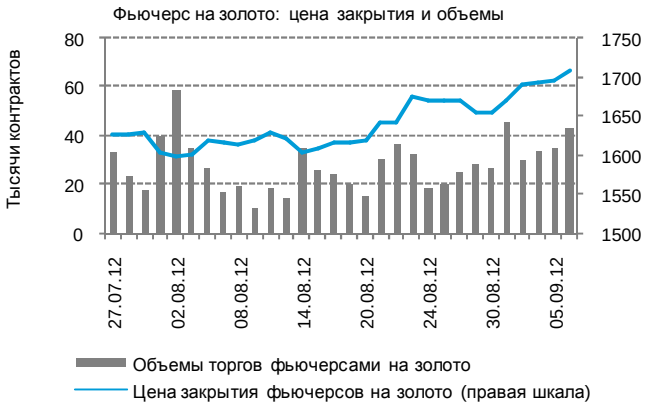


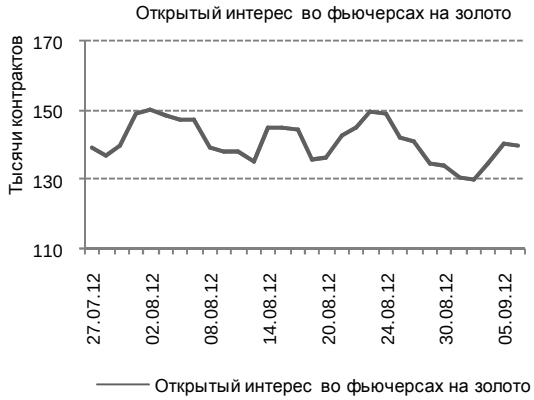
ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО - ДОЛЛАР





ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



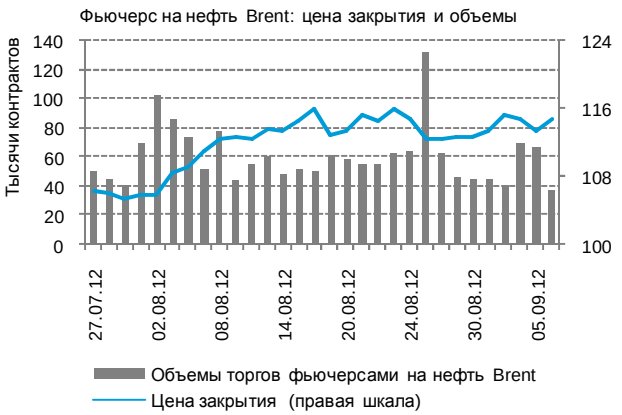


ФЬЮЧЕРС НА СЕРЕБРО



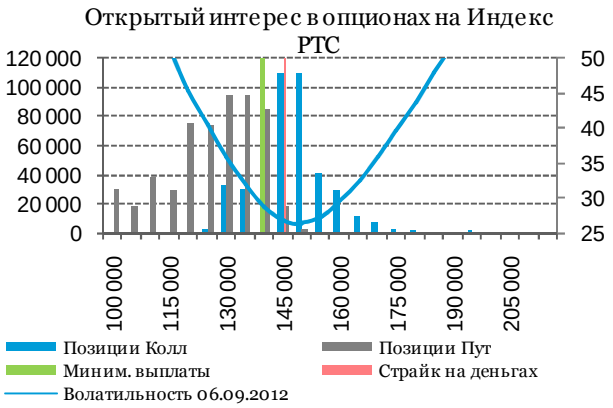


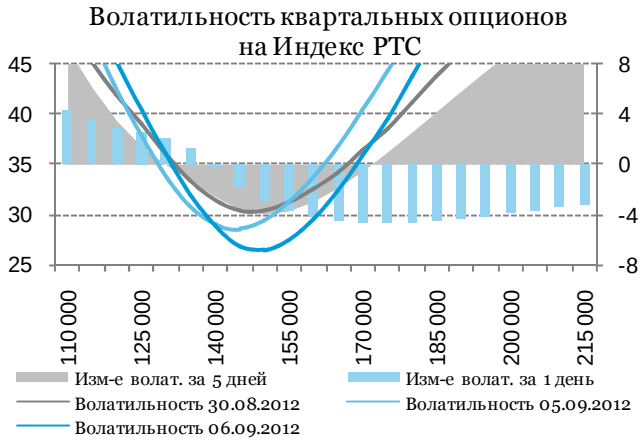
ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ BRENT

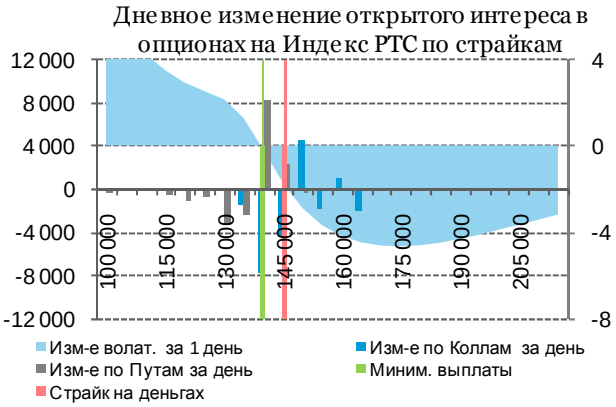


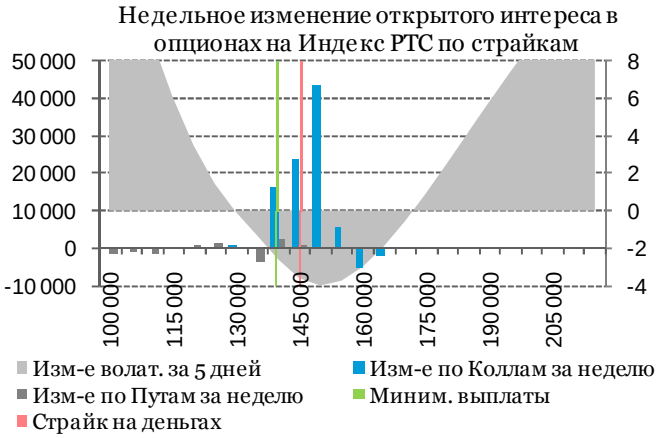


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В КВАРТАЛЬНЫХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС



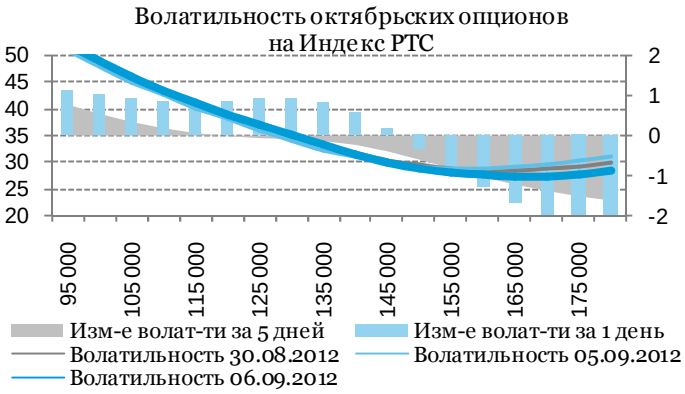


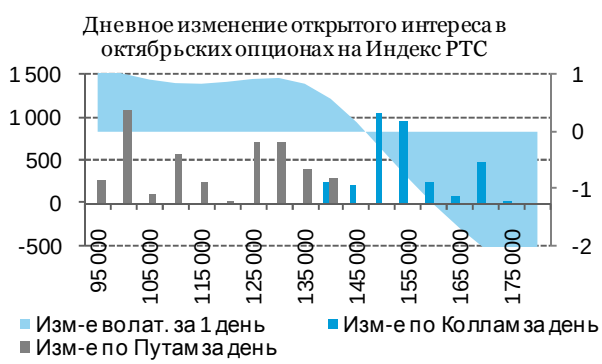


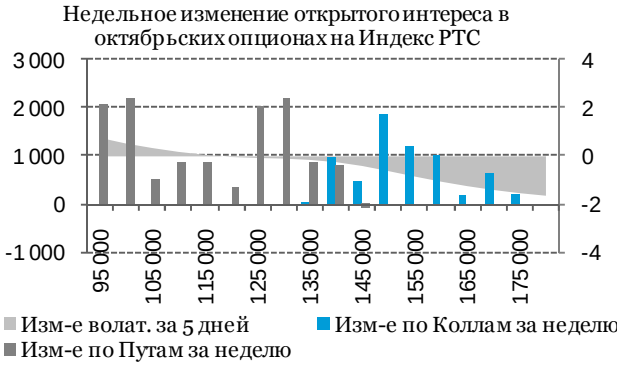


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОКТЯБРЬСКИХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС



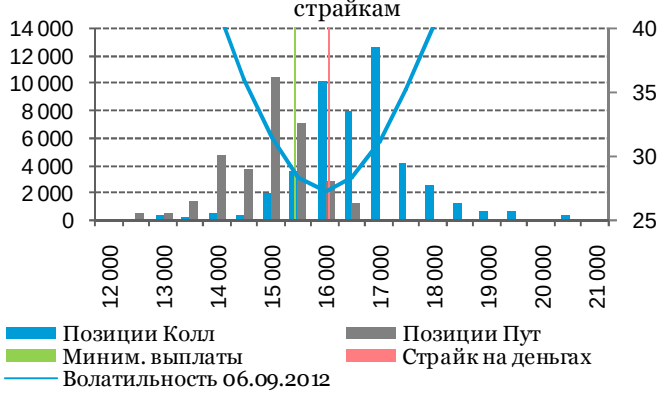




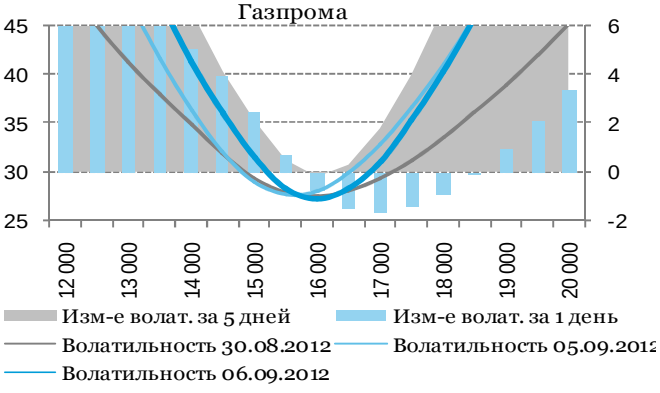


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ГАЗПРОМА

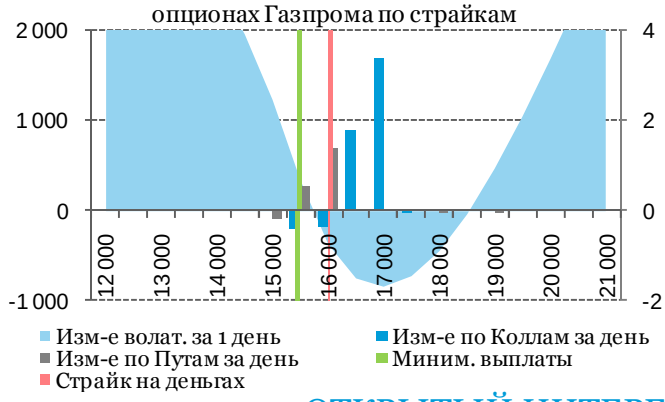
Открытый интерес в опционах Газпрома по страйкам



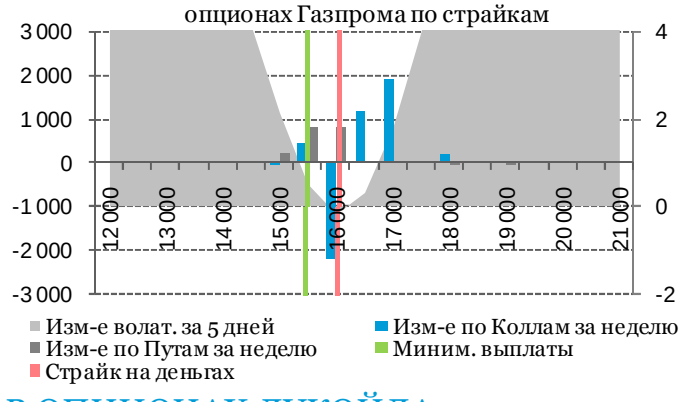
Волатильность квартальных опционов Газпрома



Дневное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

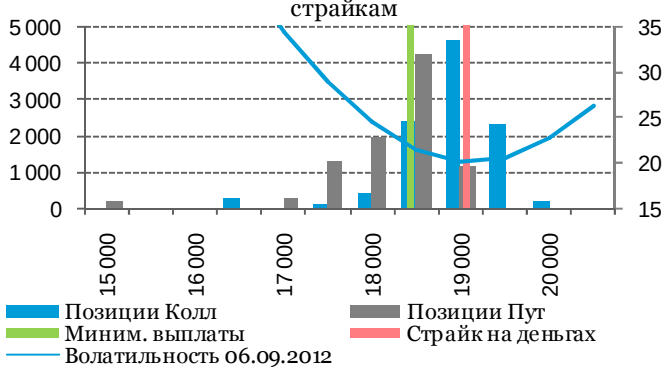


Недельное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

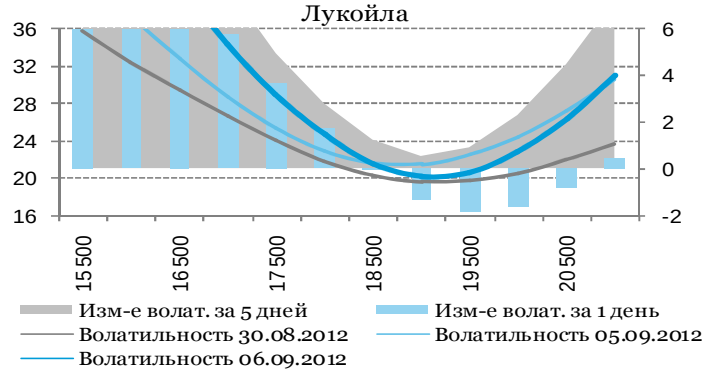


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ЛУКОЙЛА

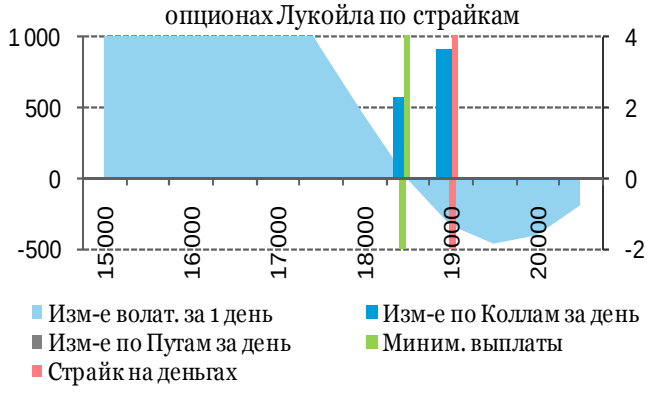
Открытый интерес в опционах Лукойла по страйкам



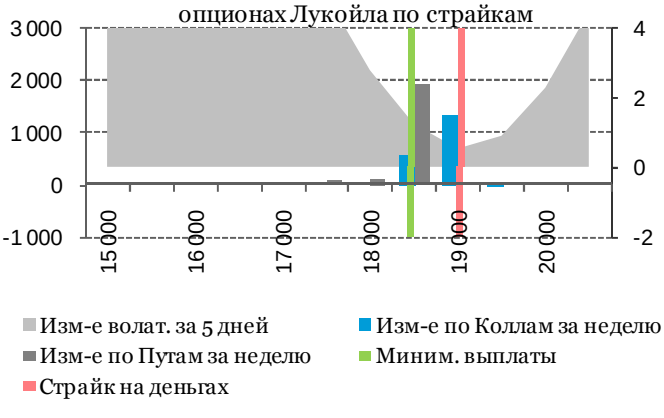
Волатильность квартальных опционов Лукойла



Дневное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

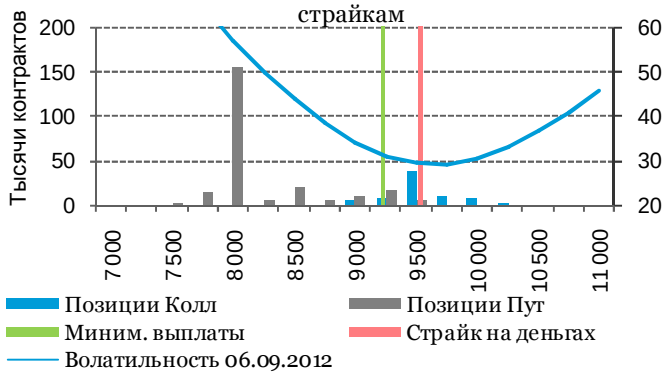


Недельное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

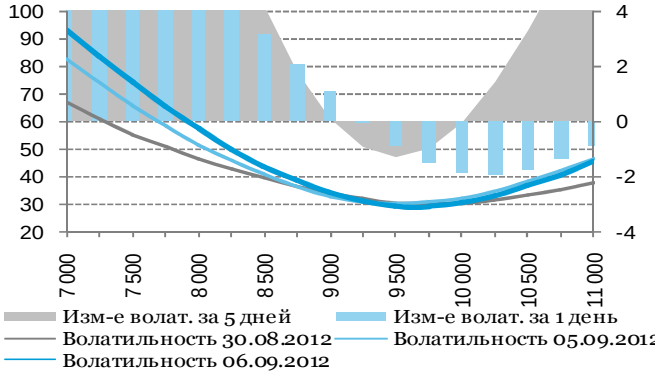


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ СБЕРБАНКА

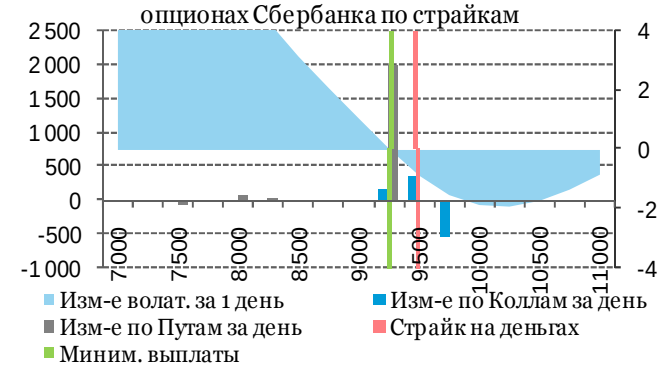
Открытый интерес в опционах Сбербанка по страйкам



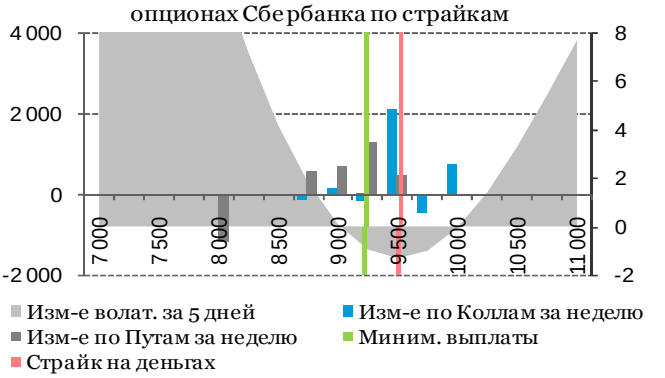
Волатильность квартальных опционов Сбербанка



Дневное изм-е открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам

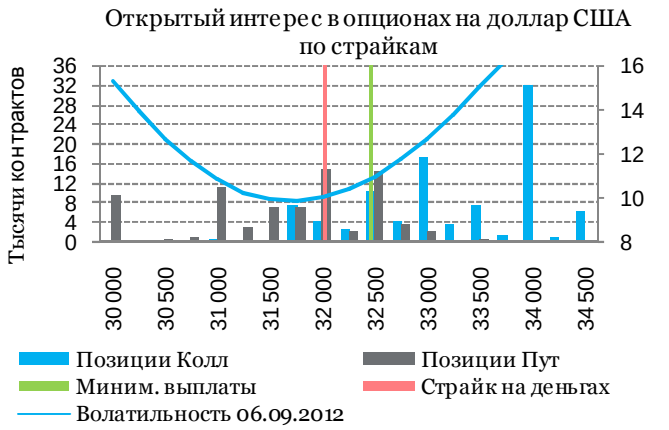


Недельное изм-е открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам

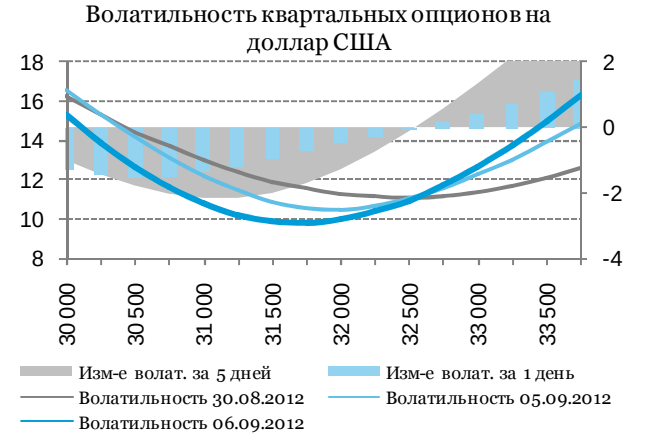


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ДОЛЛАР США

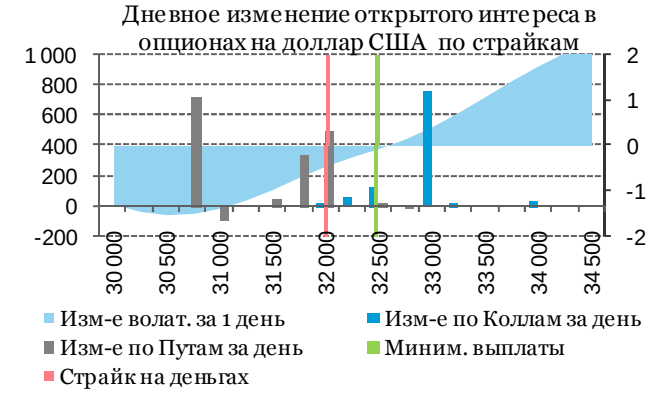
Открытый интерес в опционах на доллар США по страйкам



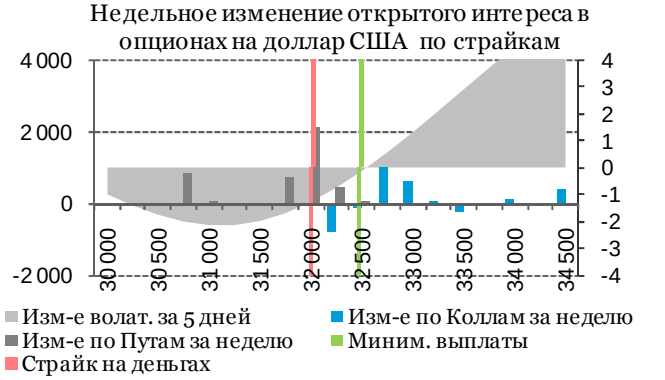
Волатильность квартальных опционов на доллар США



Дневное изменение открытого интереса в опционах на доллар США по страйкам

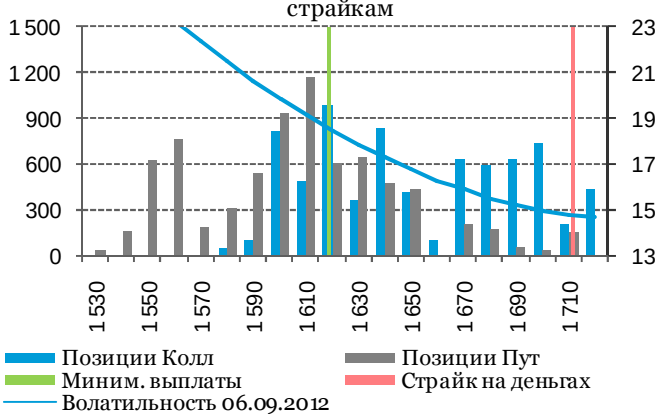


Недельное изменение открытого интереса в опционах на доллар США по страйкам

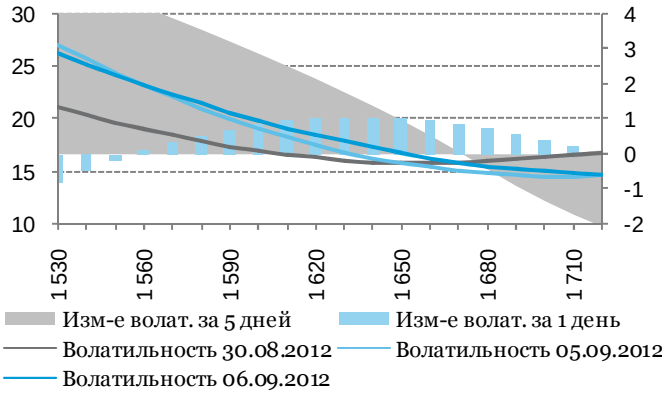


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ЗОЛОТО

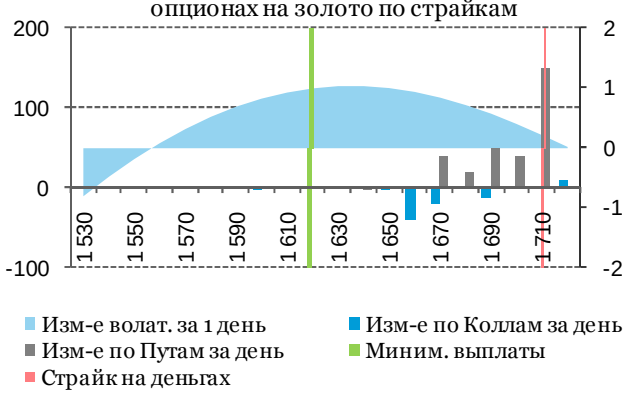
Открытый интерес в опционах на золото по страйкам



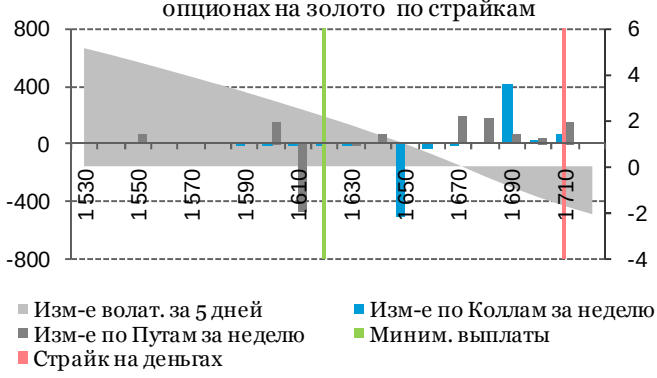
Волатильность квартальных опционов на золото



Дневное изменение открытого интереса в опционах на золото по страйкам



Недельное изменение открытого интереса в опционах на золото по страйкам



ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ» © 2012

Несанкционированное копирование, распространение, а также публикация в любых целях запрещены. ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ» (далее – «Компания»).

ПОДТВЕРЖДЕНИЕ АНАЛИТИКОВ И ОТКАЗ ОТ ОТВЕТСТВЕННОСТИ

Настоящий материал (далее – «аналитический отчет») носит исключительно информационный характер и содержит данные относительно стоимости ценных бумаг, предположения относительно будущего финансового состояния эмитентов и справедливой цены ценной бумаги на срок 12 месяцев с момента выхода настоящего аналитического отчета и/или ситуации на рынке ценных бумаг и связанных с ним событиях. Аналитический отчет основан на информации, которой располагает Компания на дату выхода аналитического отчета. Аналитический отчет не является предложением по покупке либо продаже ценных бумаг и не может рассматриваться как рекомендация к подобного рода действиям. Компания не утверждает, что все приведенные сведения являются единственно верными. Компания не несет ответственности за использование информации, содержащейся в аналитическом отчете, а также за возможные убытки от любых сделок с ценными бумагами, совершенных на основании данных, содержащихся в аналитическом отчете. Компания не берет на себя обязательство корректировать отчет в связи с утратой актуальности содержащейся в нем информации, а равно при выявлении несоответствия приводимых в аналитическом отчете данных действительности.

Инвестиции на рынке ценных бумаг сопряжены со следующими рисками: риски, связанные с ведением деятельности в конкретной юрисдикции, риски, связанные с экономическими условиями, конкурентной средой, быстрыми технологическими и рыночными изменениями, а также с иными факторами, которые могут привести к существенным отклонениям от прогнозируемых показателей. Указанные факторы могут привести к тому, что действительные результаты будут существенно отличаться от предположений или опережающих заявлений Компании, содержащихся в аналитическом отчете.

Выпуск и распространение аналитического отчета и иной информации в отношении акций в определенных юрисдикциях могут ограничиваться законом и лицам, в распоряжении которых оказывается любой документ или иная информация, упомянутая в аналитическом отчете, следует ознакомиться со всеми ограничениями и соблюдать их. Несоблюдение подобных ограничений может представлять собой нарушение законодательства таких юрисдикций о ценных бумагах. Аналитический отчет не предназначен для доступа к нему с территории Соединённых Штатов Америки (включая их территории и зависимые территории, любые штаты США и Округа Колумбия), Австралии, Канады и Японии. В Великобритании аналитический отчет адресован исключительно (1) лицам, находящимся за пределами Соединенного Королевства, либо (2) лицам, являющимся профессионалами инвестиционного рынка в соответствии со статьей 19(5) Приказа 2005 (далее – «Приказ») Закона о финансовых услугах и рынках 2000 г. (Финансовое продвижение), а также (3) высокодоходным предприятиям и иным лицам, которым оно может адресоваться на законных основаниях в соответствии со статьей 49(2) Приказа. Любое лицо, не относящееся к указанной категории лиц, не должно предпринимать никаких действий, опираясь на аналитический отчет, либо полагаться на содержащиеся в нем положения.