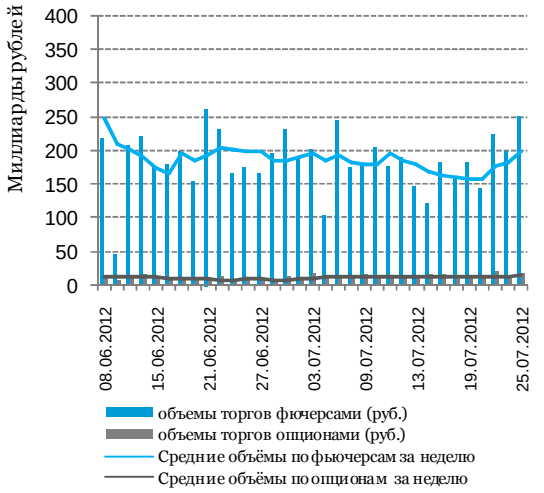
Объемы торгов фьючерсами и опционами на ФОРТС



Российский индекс волатильности RTSVX и фьючерс на него

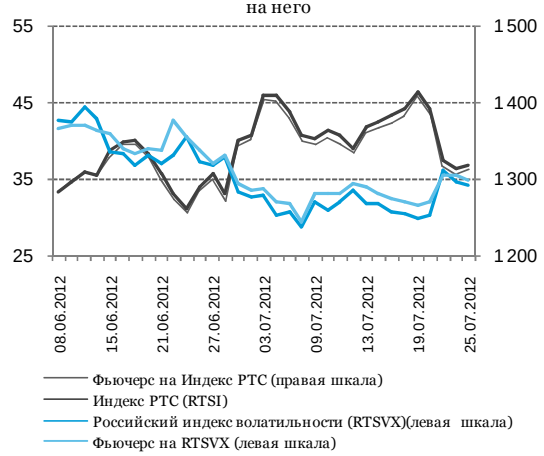
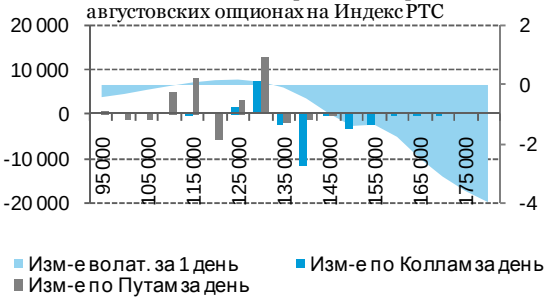


ГРАФИК ДНЯ

Дневное изменение открытого интереса в августовских опционах на Индекс РТС



ПРОДАЖИ АВГУСТОВСКИХ КОЛЛОВ НА ФОРТС

В среду, срочный рынок продемонстрировал умеренный рост котировок после распродаж накануне. Суммарные объемы торгов фьючерсами и опционами поднялись до рекордных уровней и составили 270 млрд руб. Индекс РТС вырос на 0.31% (1318.31). Фьючерс на него прибавил 0.39%, закрывшись на отметке 1 311.45 пунктов. Восходящая динамика фьючерсов сопровождалась набором открытых позиций (+3.5%) и сужением базиса до -0.52%. В сентябрьских опционах на РТС левый край улыбки волатильности просел за счет продажи путов. Суммарный интерес в опционах на продажу на 1 200 – 1 300 страйках вырос на 4 000 контрактов. Также обращает на себя внимание закрытие позиций в путах на 1 000 страйке (- 4000 контрактов). В августовских контрактах участники торгов продавали правый край улыбки волатильности. На 1 400 – 1 550 страйках интерес в коллах сократился на 18 000 контрактов.

Индекс волатильности RTSVX снизился на 1.19% (34.17), фьючерс на волатильность подешевел на 1.41% (34.9). В США индекс VIX просел на 5.52% (19.34). Разница между показателями волатильности RTSVX и VIX держится около 15 пунктов.

Фьючерсы на акции завершили сессию разнонаправленной динамикой котировок на высоких объемах. Контракты Газпрома подорожали на символические 0.03% (147.29). Интерес практически не изменился, базис сузился до 0.89%. Контракты Лукойла закрылись на красной территории (-0.62%; 1781.8), число открытых позиций незначительно выросло, базис сократился до 0.39%. Фьючерсы Норильского никеля также закрылись в минусе (-0.47%; 4980). При этом интерес увеличился на 4%. Базис расширился с 0.85 до 1.01%. Банковский сектор также показал смешанную динамику. Сбербанк вырос на 2.40% (87.36) интерес практически не изменился. Контракты ВТБ потеряли 0.12% (5161). Повышение котировок проходило на фоне наращивания позиций участниками рынка (+1%). При этом базис расширился с 1.92% до 1.06%.

Фьючерсы на курс доллар-рубль снизились впервые за четыре торговых сессии (-0.17%; 33.01), при этом интерес довольно резко просел (-7%), что может свидетельствовать о фиксации прибыли участниками рынка. Контракты на евро-доллар подросли впервые за четыре дня (+0.27%; 1.2131), при этом участники торгов закрыли позиции, открытые ранее (-2%).

Во фьючерсах на драгоценные металлы наблюдался уверенный рост котировок. Активность участников приближалась к рекордным отметкам. Золото подорожало на 1.32% ($1 605), интерес вырос на 6%. В серебре (+0.52%; $27.33) позиции сократились на 6%. Во фьючерсах на нефть марки Brent на фоне снижения котировок (-0.63; $103.0) наблюдался активный набор позиций (+12%)

В вечернюю торговую сессию на ФОРТС фьючерсы на РТС продолжили восходящую динамику (+0.44%). Американские площадки закрылись разнонаправлено. S&P500 (-0.03%; 1337.89). DOW (+0.47%; 12 676).

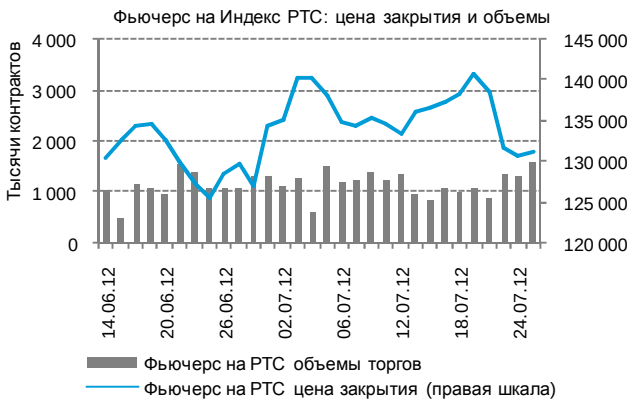
Перед открытием торгов фьючерсы на S&P500 не меняются в цене, пара евро-доллар теряет 0.11% (1.2141). Brent (-0.66%; $103.91), WTI (-0.48%, $88.56).

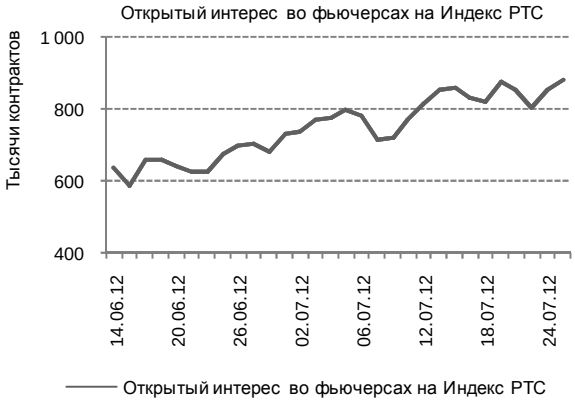
Мы ожидаем открытия срочного рынка на0.2% ниже уровней вечерней сессии.

Зайцев Павел

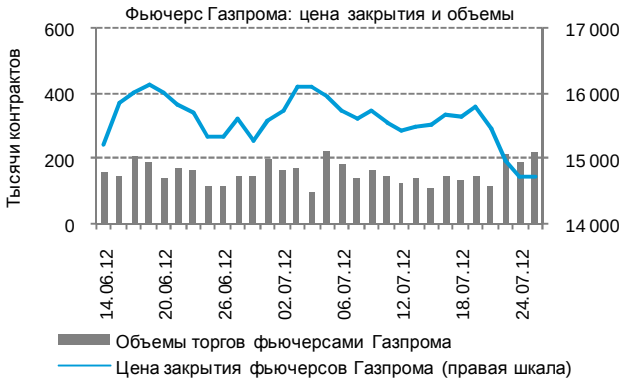
ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ»

ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС



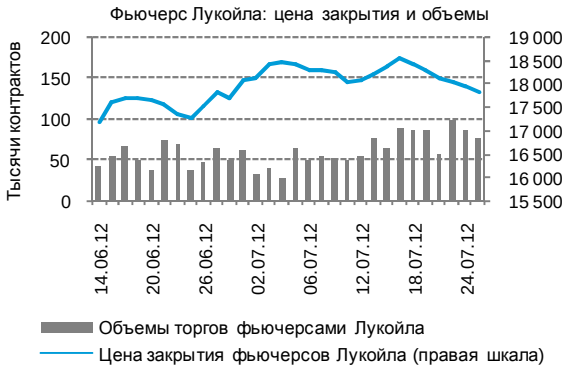


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



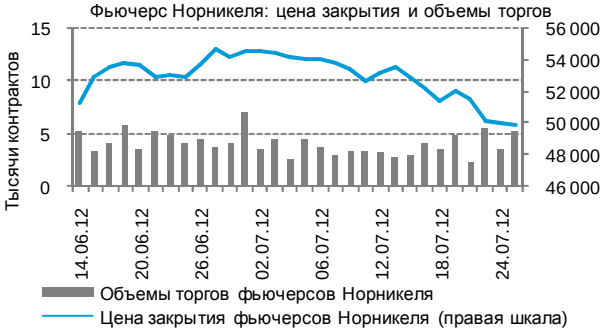


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА



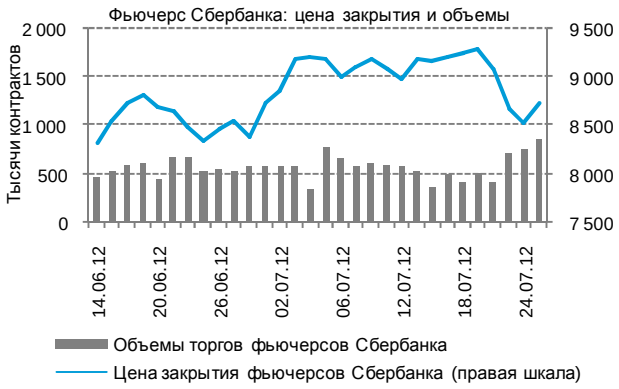


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК «НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ»



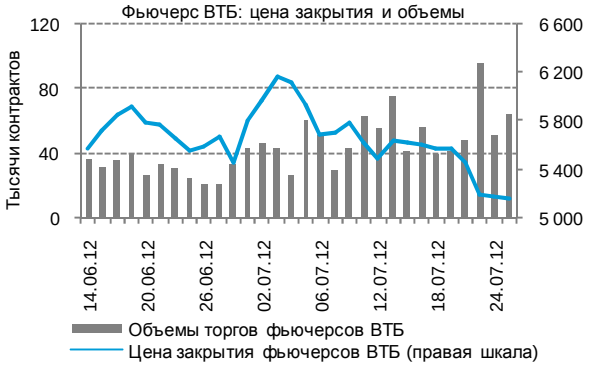


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА



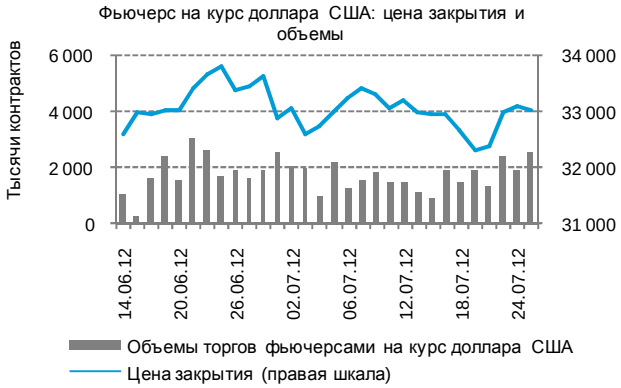


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ



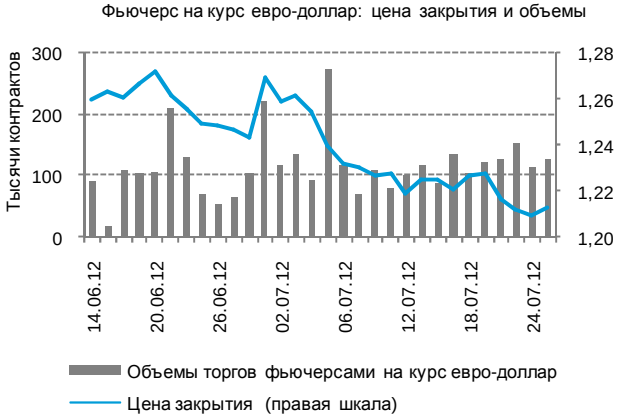


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ДОЛЛАРА США



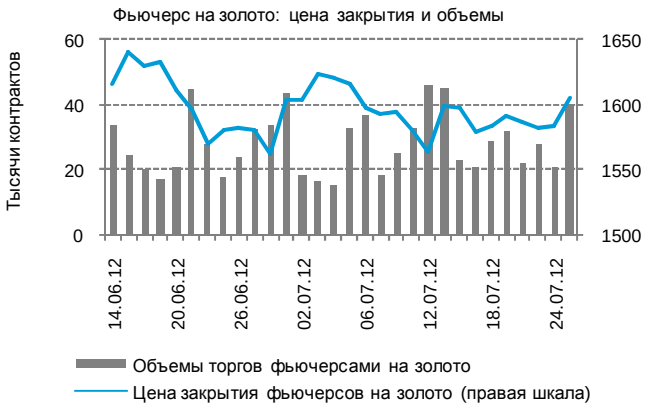


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО - ДОЛЛАР



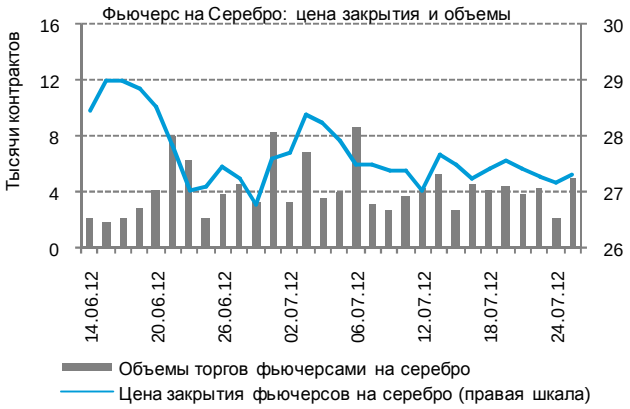


ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



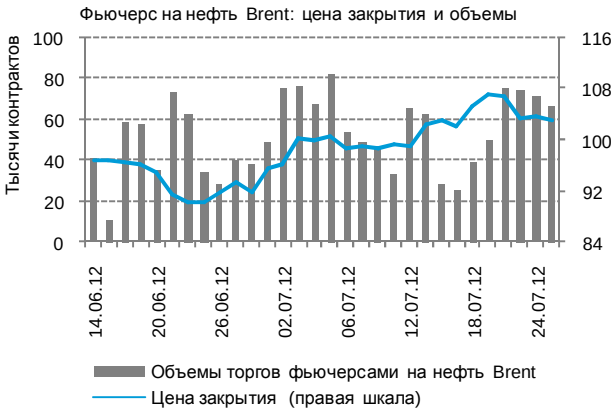


ФЬЮЧЕРС НА СЕРЕБРО





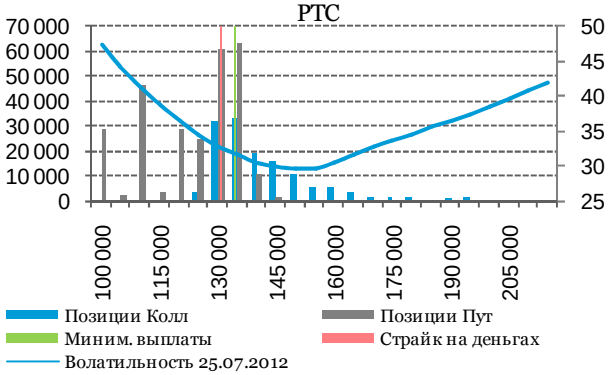
ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ BRENT



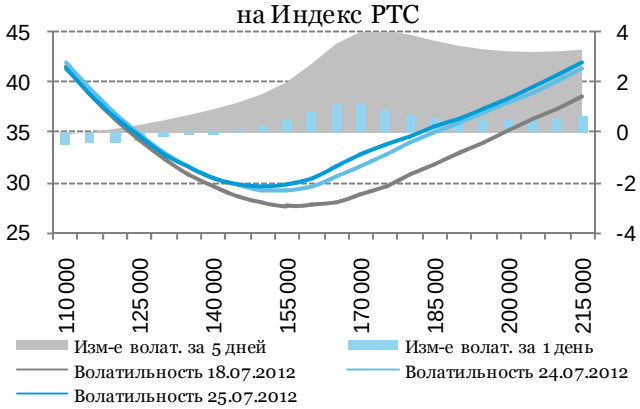


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В КВАРТАЛЬНЫХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС

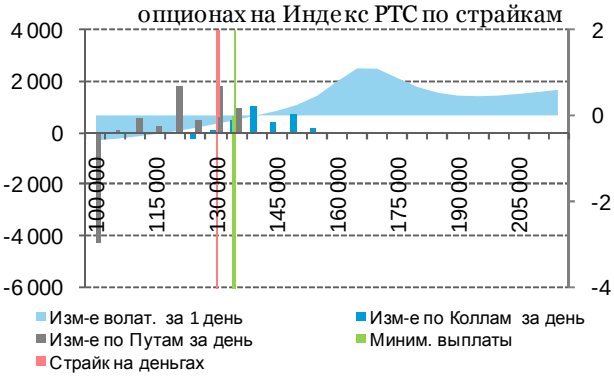
Открытый интерес в опционах на Индекс РТС



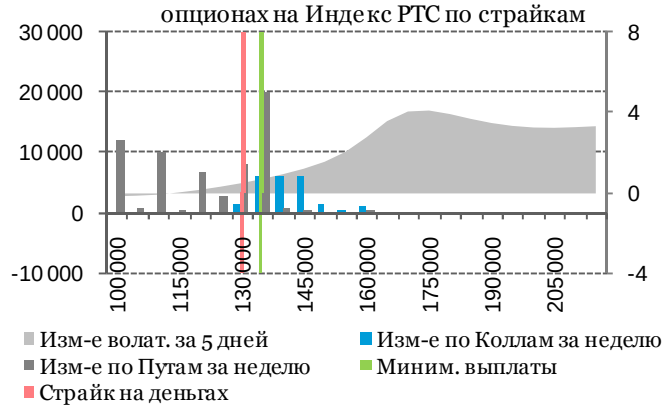
Волатильность квартальных опционов на Индекс РТС



Дневное изменение открытого интереса в опционах на Индекс РТС по страйкам

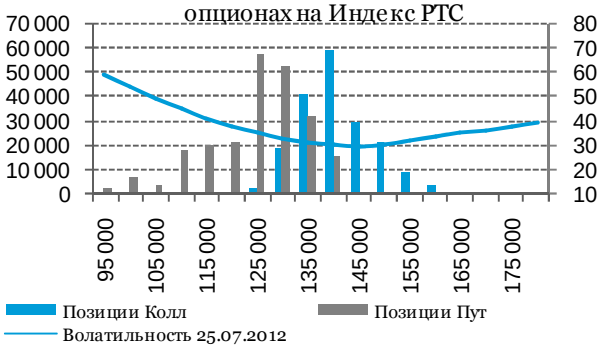


Недельное изменение открытого интереса в опционах на Индекс РТС по страйкам

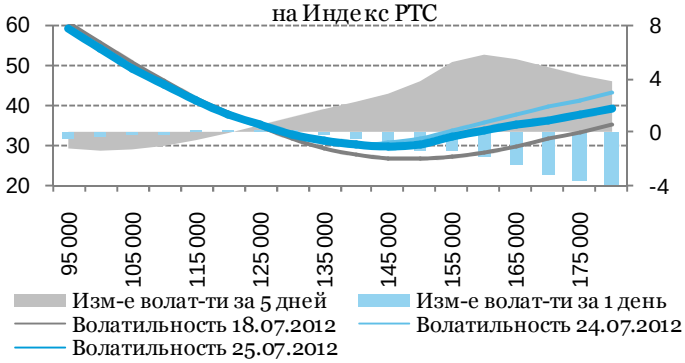


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В АВГУСТОВСКИХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС

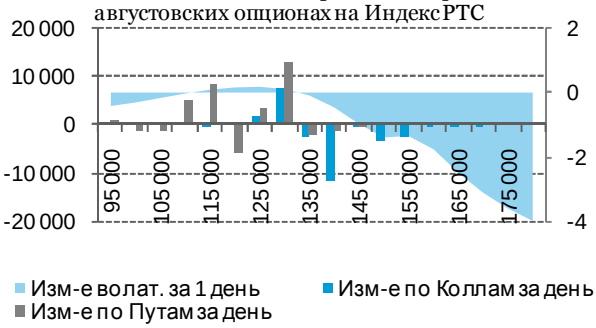
Открытый интерес в августовских опционах на Индекс РТС



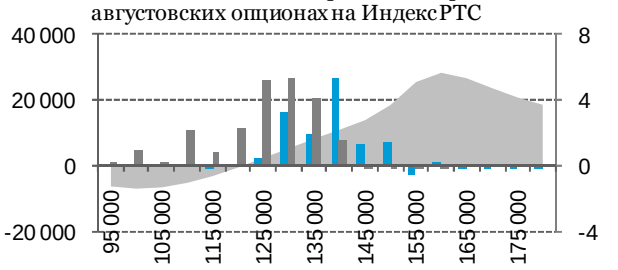
Волатильность августовских опционов на Индекс РТС



Дневное изменение открытого интереса в августовских опционах на Индекс РТС

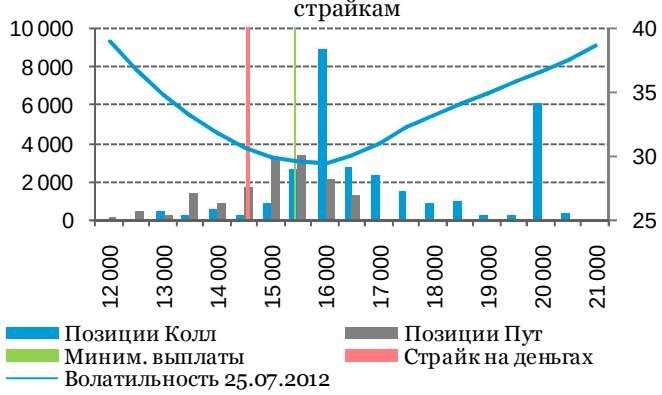


Недельное изменение открытого интереса в августовских опционах на Индекс РТС

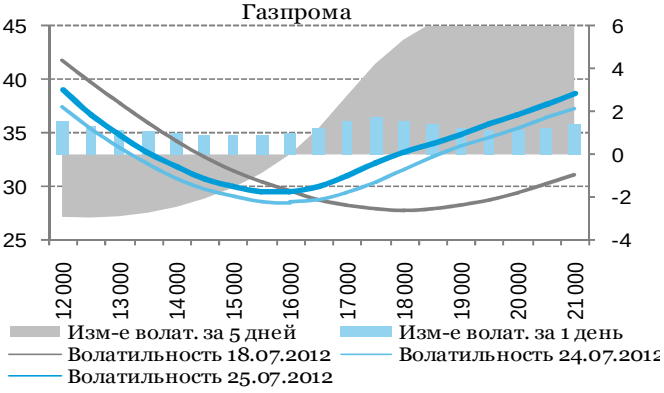


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ГАЗПРОМА

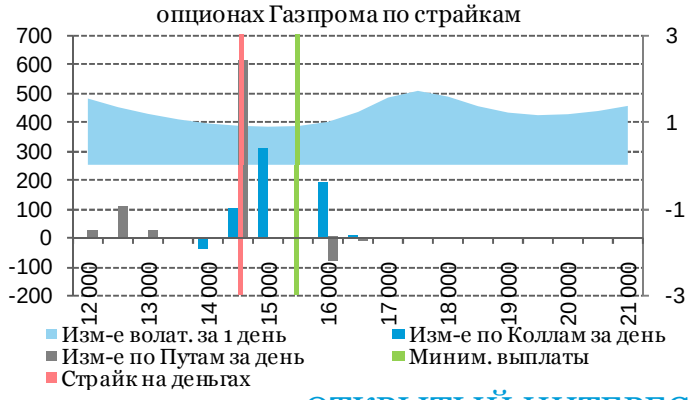
Открытый интерес в опционах Газпрома по страйкам



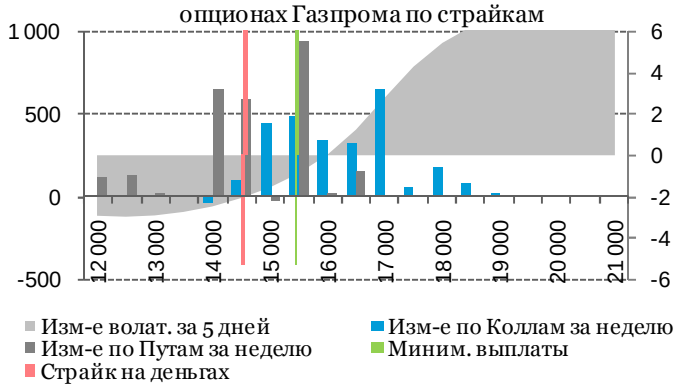
Волатильность квартальных опционов Газпрома



Дневное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

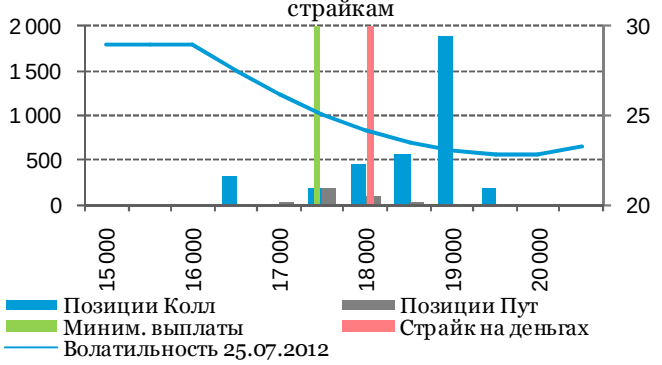


Недельное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

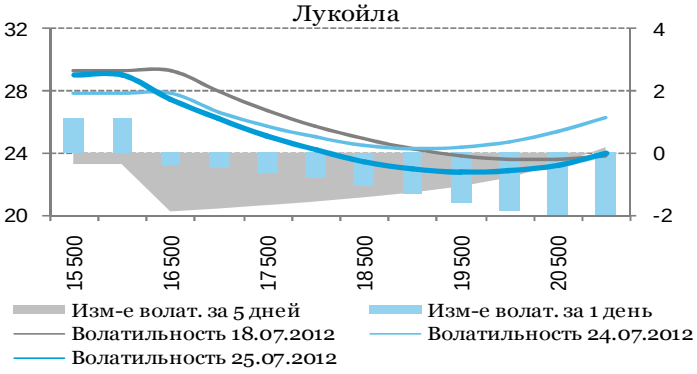


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ЛУКОЙЛА

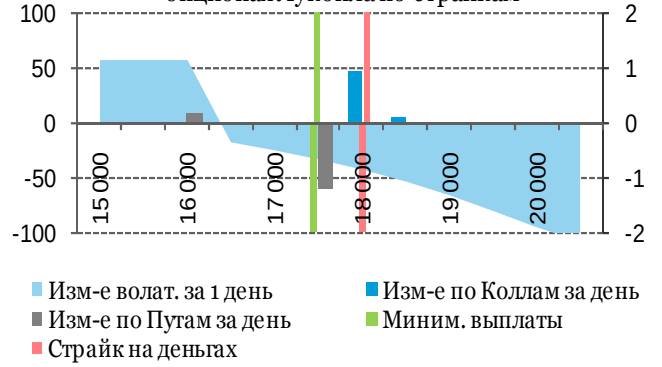
Открытый интерес в опционах Лукойла по страйкам



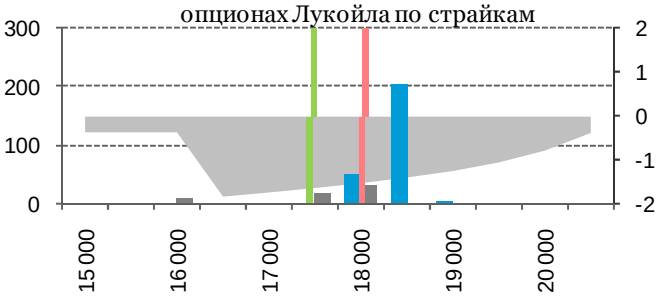
Волатильность квартальных опционов Лукойла



Дневное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

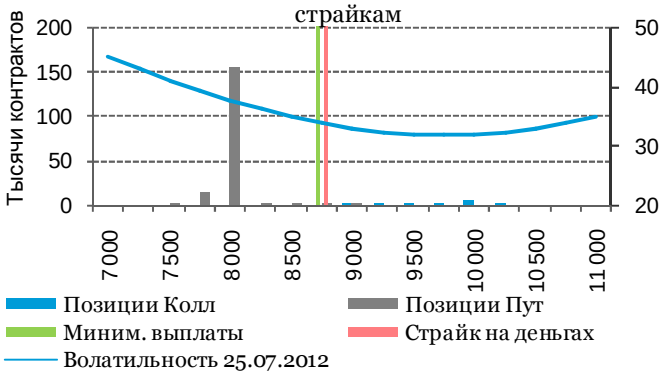


Недельное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

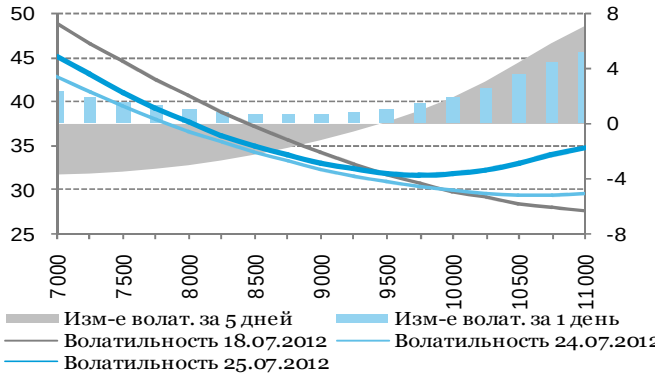


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ СБЕРБАНКА

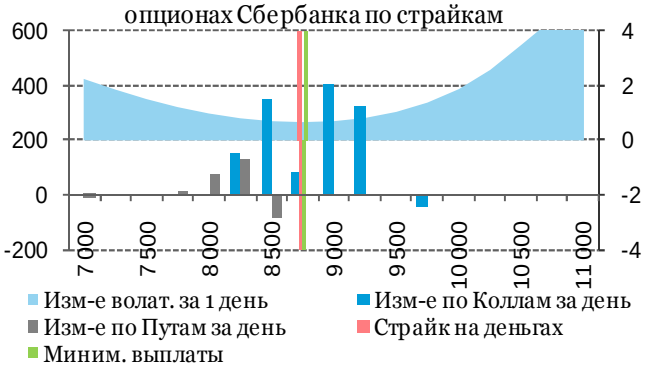
Открытый интерес в опционах Сбербанка по страйкам



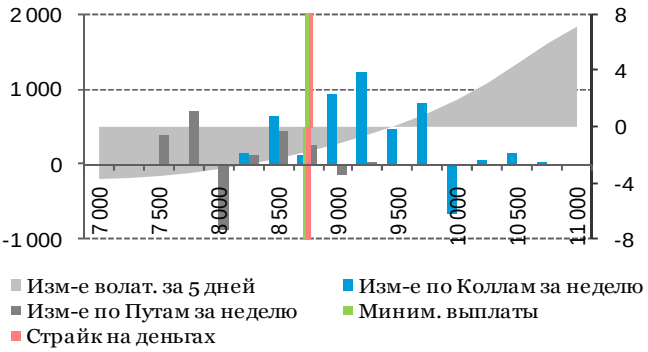
Волатильность квартальных опционов Сбербанка



Дневное изм-е открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам

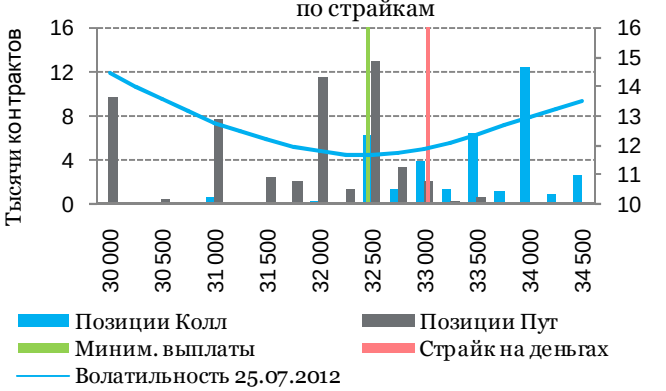


Недельное изм-е открытого интереса в опционах Сбербанка по страйкам

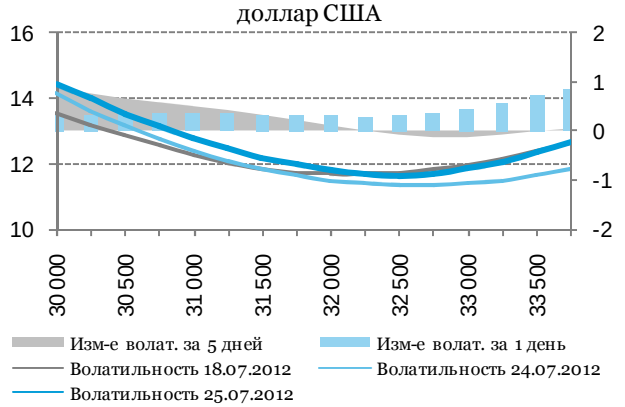


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ДОЛЛАР США

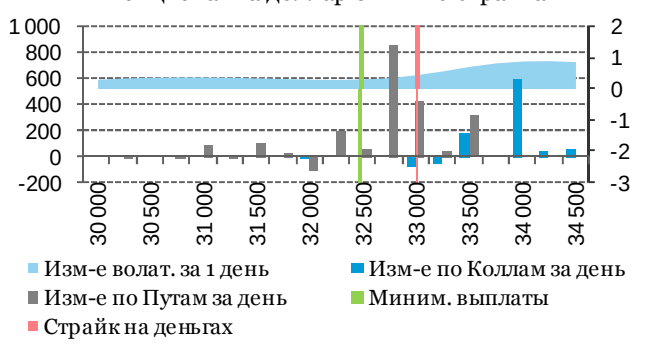
Открытый интерес в опционах на доллар США по страйкам



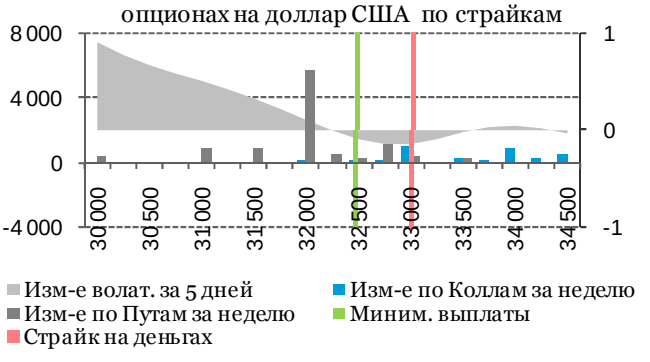
Волатильность квартальных опционов на доллар США



Дневное изменение открытого интереса в опционах на доллар США по страйкам

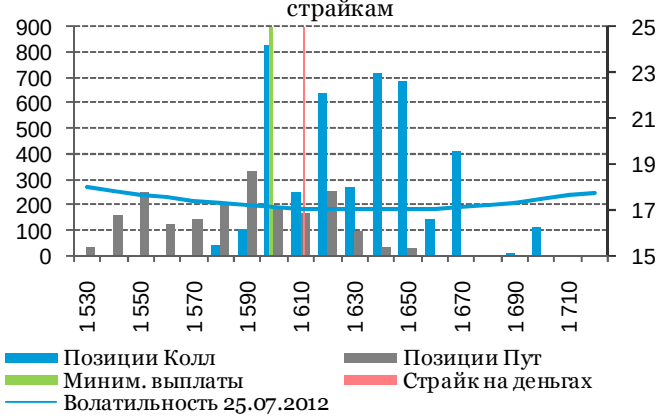


Недельное изменение открытого интереса в опционах на доллар США по страйкам

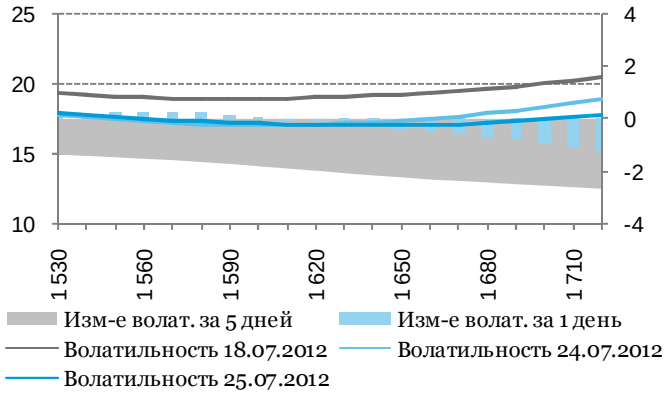


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ЗОЛОТО

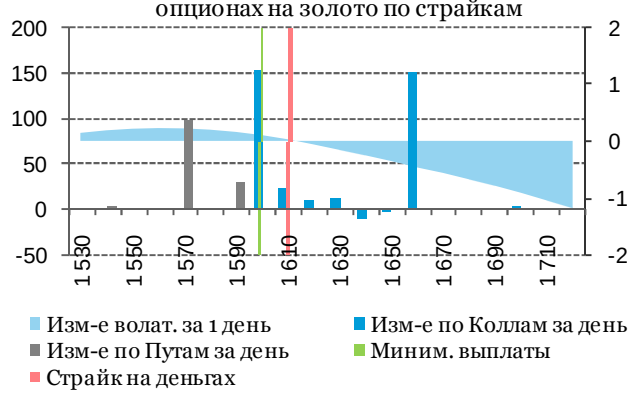
Открытый интерес в опционах на золото по страйкам



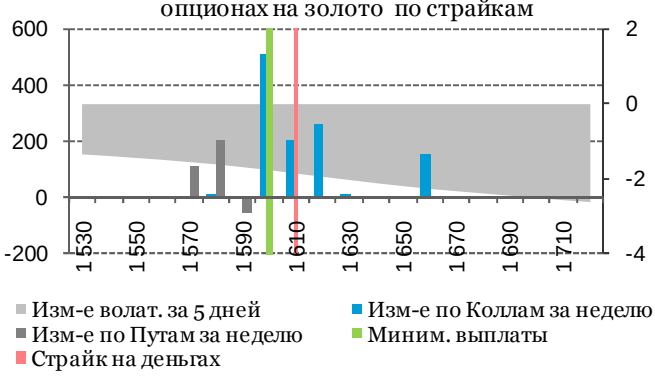
Волатильность квартальных опционов на золото



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.