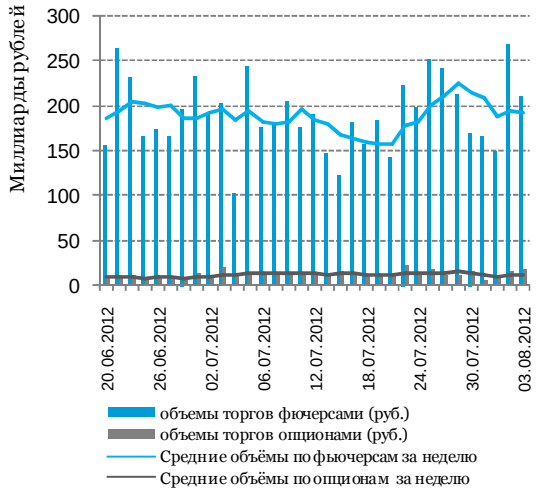
Объемы торгов фьючерсами и опционами на ФОРТС



Российский индекс волатильности RTSVX и фьючерс на него

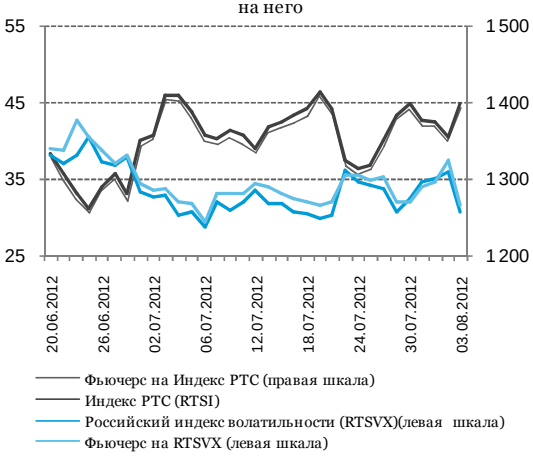


ГРАФИК ДНЯ

Открытый интерес во фьючерсах на нефть Brent



ВОЛАТИЛЬНАЯ НЕДЕЛЯ НА ФОРТС

Минувшая неделя на ФОРТС оказалась крайне волатильной. Со вторника по четверг рынок снижался, но в пятницу котировки поднялись до уровней середины июля. Суммарные обороты по фьючерсам и опционам составили 227 млрд руб.

Индекс РТС в пятницу взлетел на 3.17% (1398.33), фьючерс на него вырос на 3.29%; 1393.55 п. Базис сузился с -0.45% до -0.34%. Бурный рост фьючерсов сопровождался агрессивным набором позиций: интерес в контрактах на РТС вырос сразу на 10%. В сентябрьских опционах на РТС в конце недели начались активные продажи волатильности. На центральных страйках улыбка просела на 2.0 – 3.1%. В коллах интерес вырос на 1 350 – 1 500 страйках (+6 000 контрактов). Следует выделить покупку путов на 1 100 страйке. За неделю интерес на этом уровне вырос на 24 000 контрактов. В августовских опционах продажи волатильности наблюдались на всем диапазоне страйков. Улыбка просела на 1.3 – 6.2%. Особенно выделялся набор позиций в путах на 1 250 страйке (+14 000 контрактов). В коллах участники наращивали позиции на 1 300 – 1 450 страйках (+ 11 600 контрактов).

Индекс волатильности RTSVX рос с понедельника по четверг, достигнув максимума на отметке 36,01. В пятницу индикатор откатился на уровни конца июля (-14.47%; 30.8). Фьючерс на волатильность подешевел на 15.78% (31.5). За океаном индекс VIX, потерял 10.98%, закрывшись на уровне 15.64. Разница между RTSVX и VIX сузилась до 15 пунктов.

Фьючерсы на акции показали восходящую динамику. Локомотивом роста явились контракты Сбербанка (3.17%; 92.22). Повышение котировок до уровней середины июля сопровождалось наращиванием позиций (+5%). Контракты ВТБ также поднялись к уровням двухнедельной давности (+2.43%; 5525), однако, здесь участники торгов закрывали короткие позиции. В пятницу сокращение интереса составило 4%, за неделю позиции сократились на 10%. Контракты Газпрома также показали внушительный рост (+1.76%; 152.2%). Базис сузился с 0.94% до 0.76%. Игроки активно входили в эти фьючерсы – открытый интерес вырос на 3%. Лукойл показал самый скромный рост из ликвидных фьючерсов (+0.57%; 1834), число открытых позиций выросло на 0.3%, базис сузился с 0.25% до 0.19%. Фьючерсы Норильского никеля завершили неделю ростом котировок (+0.94%; 5125), базис сузился до 0.61%. Открытый интерес сократился на 0.5%.

Резкое укрепление Рубля к уровням третьей недели июля оказало весомую поддержку рисковым активам (-1.47%; 32.23). Движение проходило на фоне сдержанного закрытия позиций (-1.2%). Фьючерсы на пару евро-доллар в пятницу также отыграли снижение всей недели (+1.22%$ 1.2342), при этом число открытых позиций обвалилось на 15%.

Во фьючерсах на драгоценные металлы наблюдалась восходящая динамика котировок на фоне сокращения интереса. Золото прибавило 0.18%, завершив неделю на отметке $1602. За пять торговых сессий интерес увеличился на 7%. Серебро подорожало в пятницу на 1.43% ($27.69), интерес сократился на 6%. Контракты на нефть Brent прибавили 2.38% ($108.4) на оборотах, близких к рекордным. При этом интерес вырос на 36%.

В вечернюю торговую сессию фьючерсы на РТС подорожали еще на 0.3% на фоне роста американских площадок. Индекс S&P500 прибавил 1.90% (1390.99), DOW вырос на 1.69% (13 096).

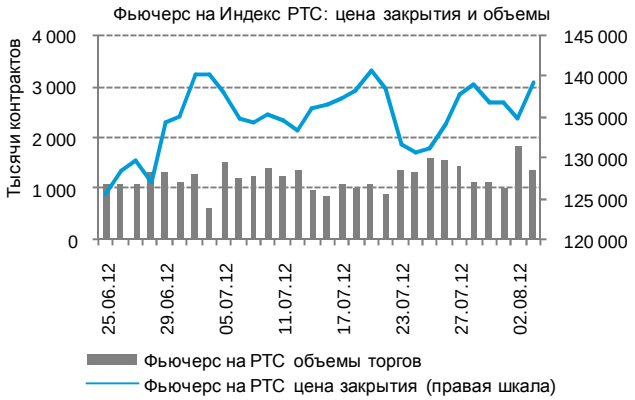
Перед открытием торгов в понедельник фьючерсы на S&P500 не меняются в цене. Brent (+0.04%; $108.5), WTI (-0.22%; $91.14). Пара евро-доллар растет на 0.03% (1.2391).

Мы ожидаем открытия срочного рынка на уровнях вечерней сессии.

Зайцев Павел

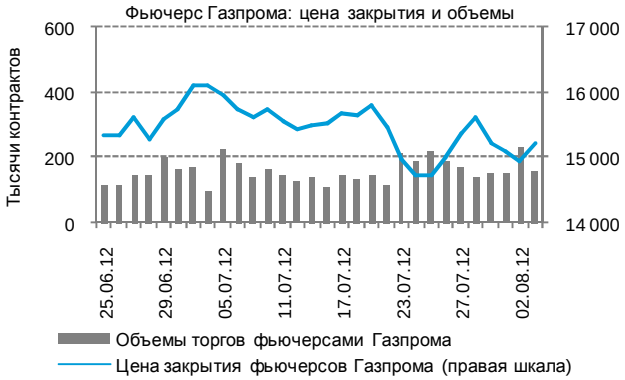
ОАО «Брокерский дом «ОТКРЫТИЕ»

ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС РТС



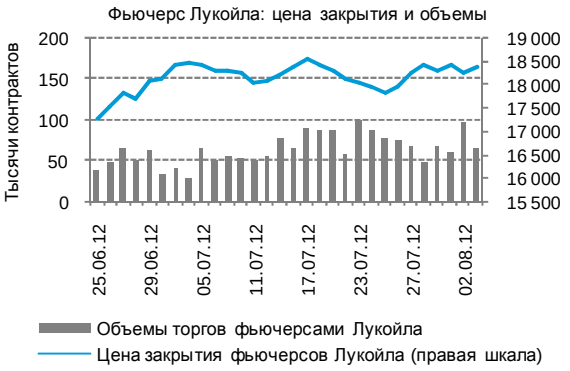


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГАЗПРОМА



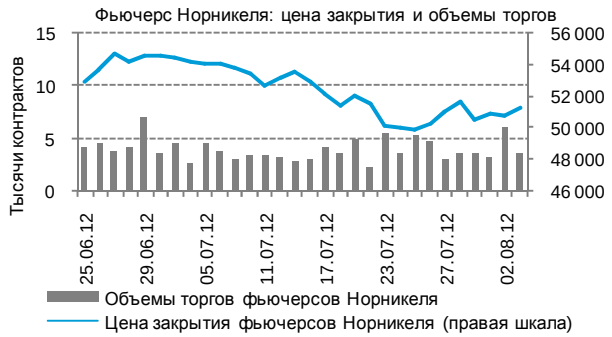


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ЛУКОЙЛА



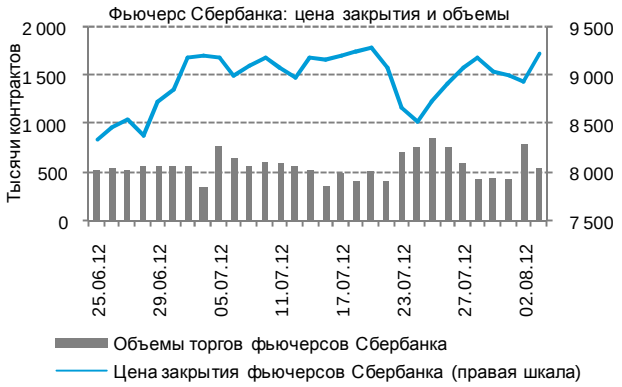


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ГМК «НОРИЛЬСКИЙ НИКЕЛЬ»



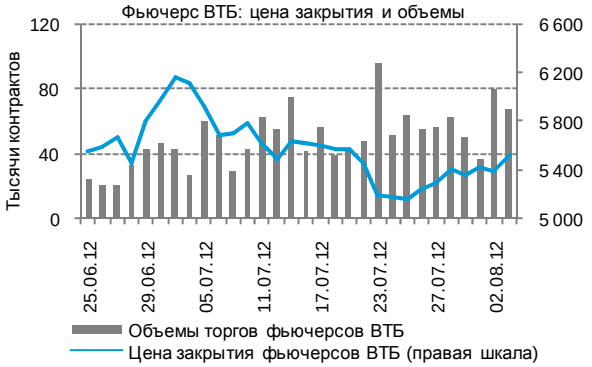


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ СБЕРБАНКА



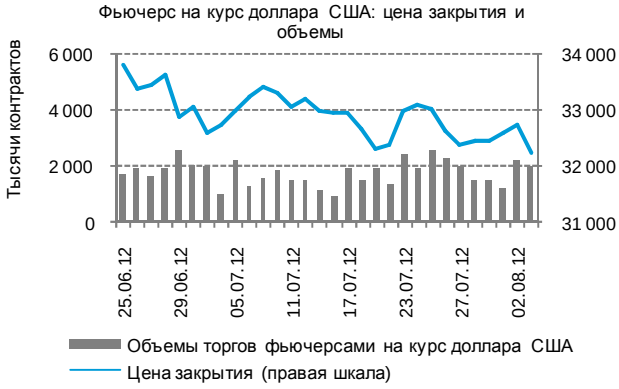


ФЬЮЧЕРС НА АКЦИИ ВТБ



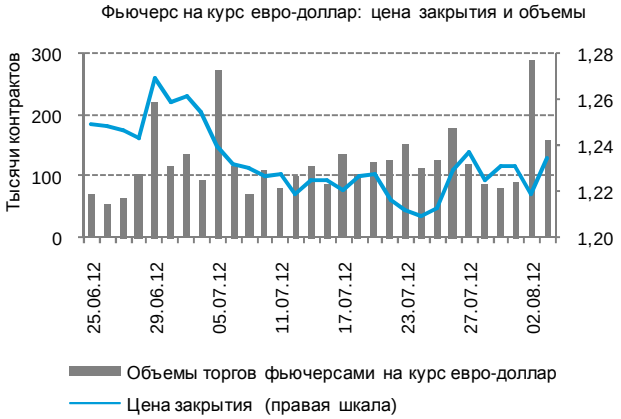


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ДОЛЛАРА США



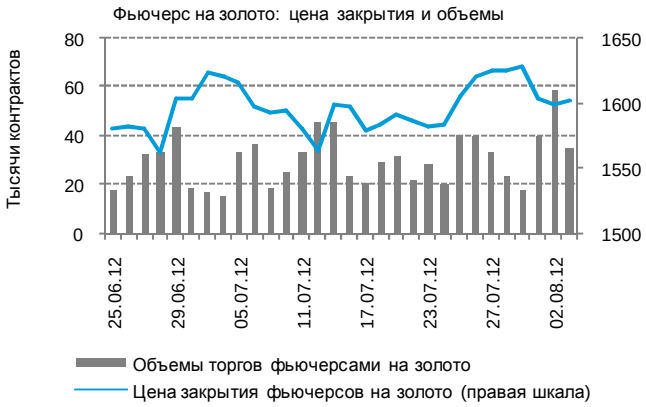


ФЬЮЧЕРС НА КУРС ЕВРО - ДОЛЛАР



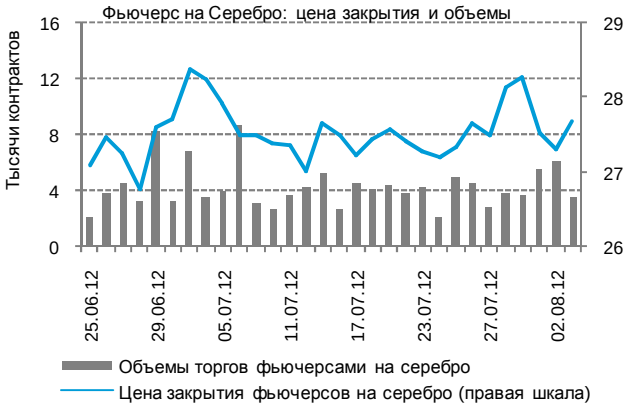


ФЬЮЧЕРС НА ЗОЛОТО



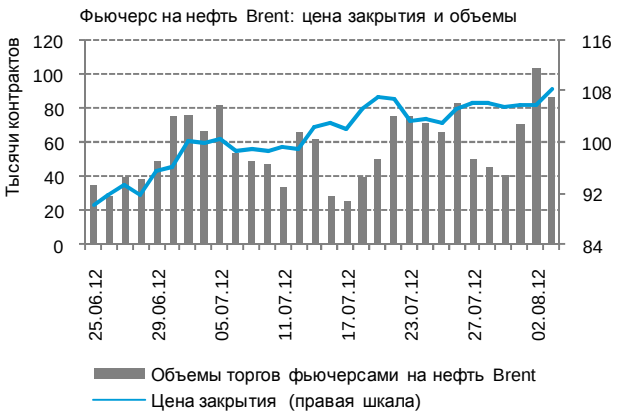


ФЬЮЧЕРС НА СЕРЕБРО





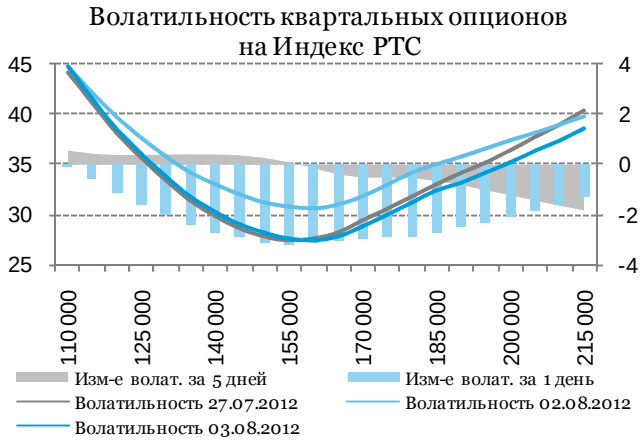
ФЬЮЧЕРС НА НЕФТЬ BRENT

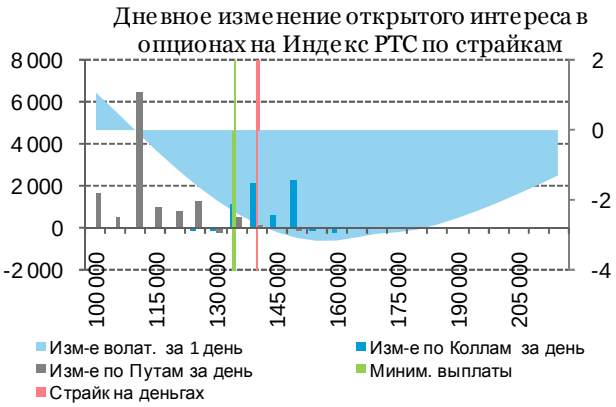


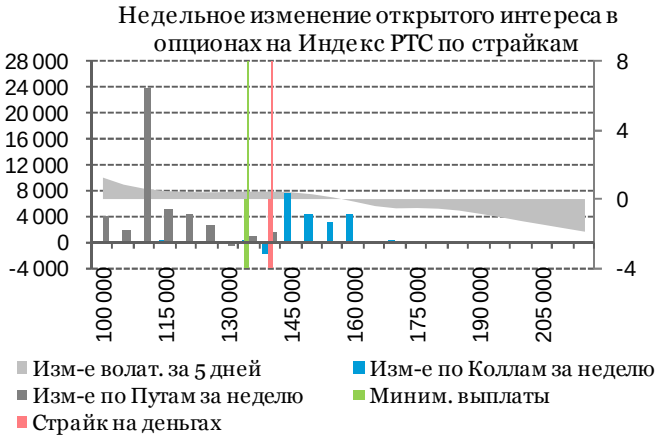


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В КВАРТАЛЬНЫХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС



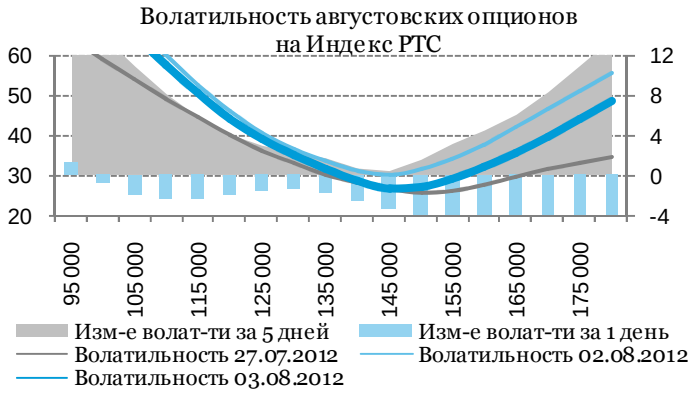


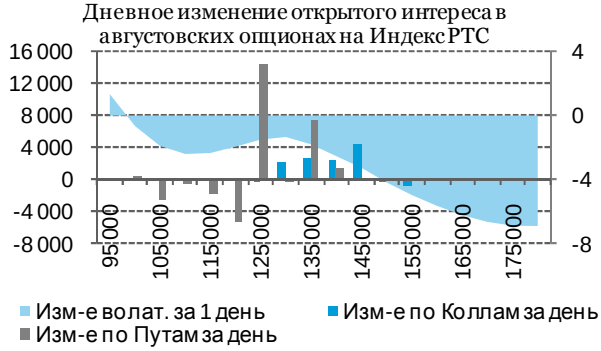




ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В АВГУСТОВСКИХ ОПЦИОНАХ НА ИНДЕКС РТС



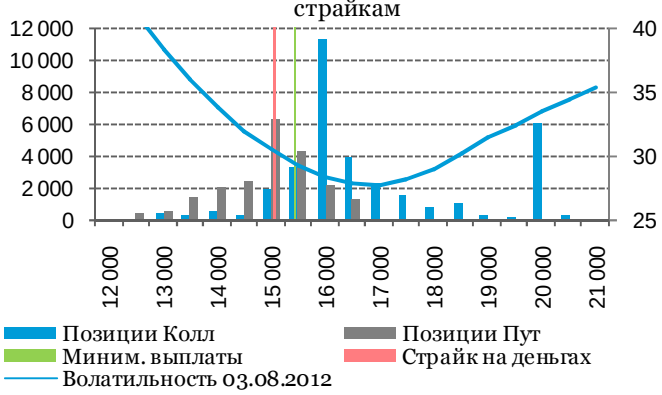




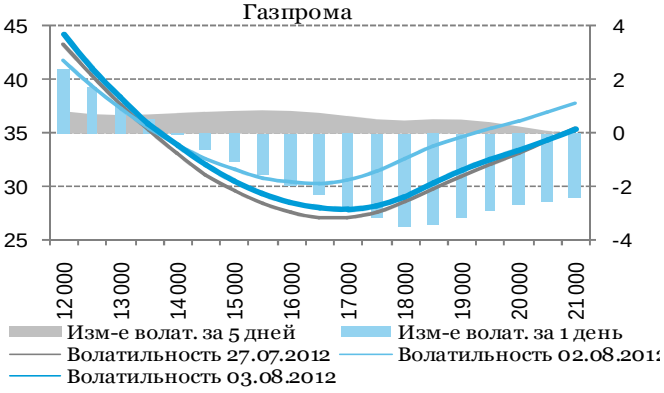


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ГАЗПРОМА

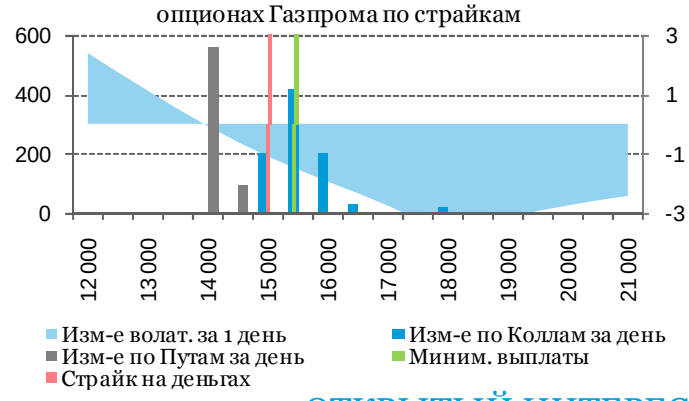
Открытый интерес в опционах Газпрома по страйкам



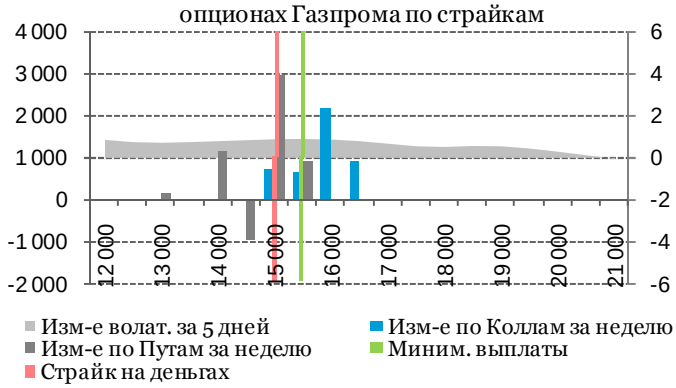
Волатильность квартальных опционов Газпрома



Дневное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

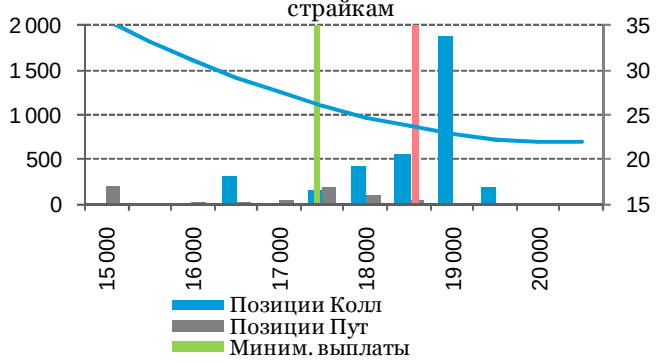


Недельное изменение открытого интереса в опционах Газпрома по страйкам

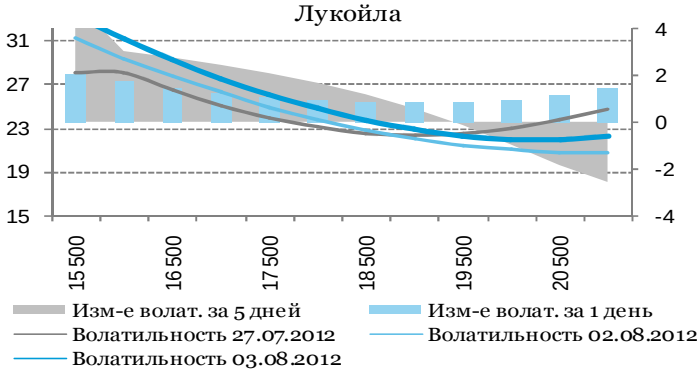


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ ЛУКОЙЛА

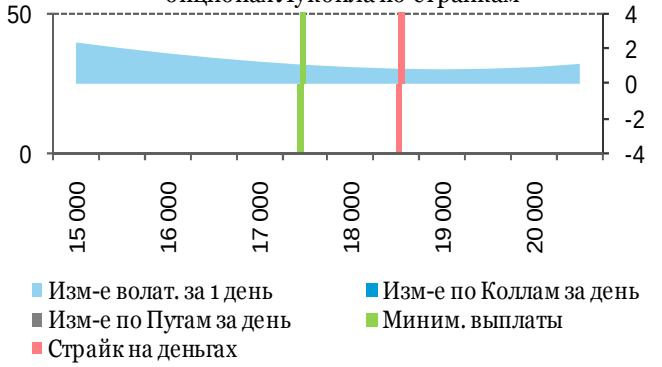
Открытый интерес в опционах Лукойла по страйкам



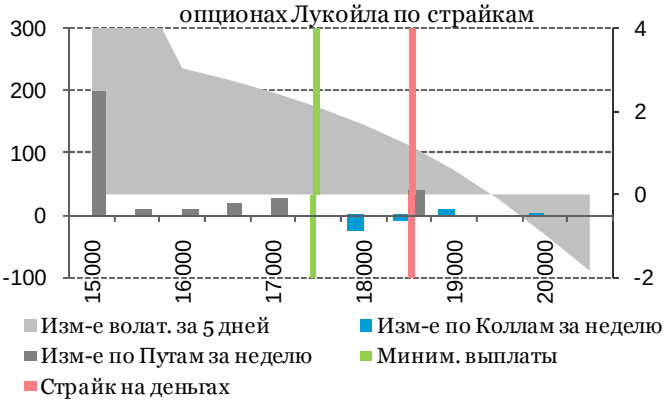
Волатильность квартальных опционов Лукойла



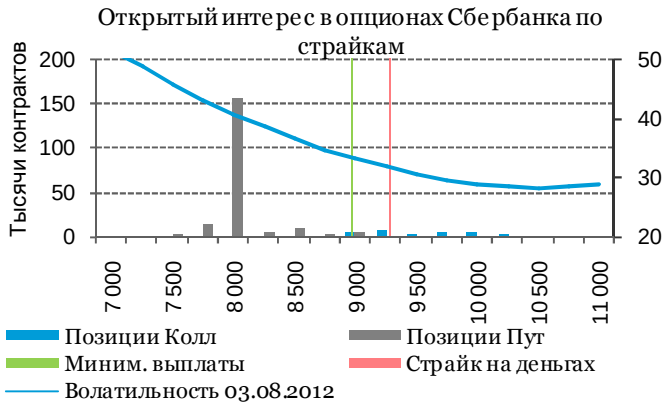
Дневное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

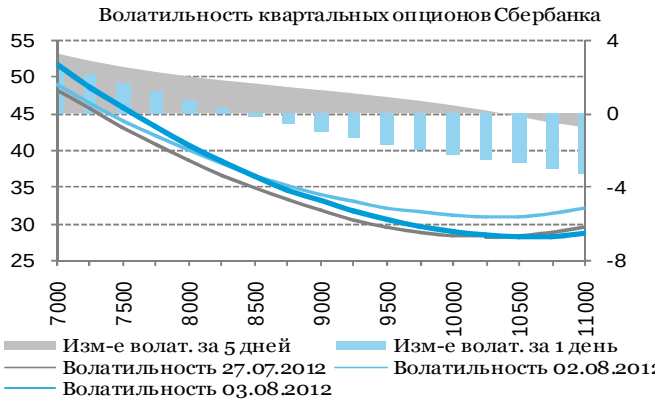


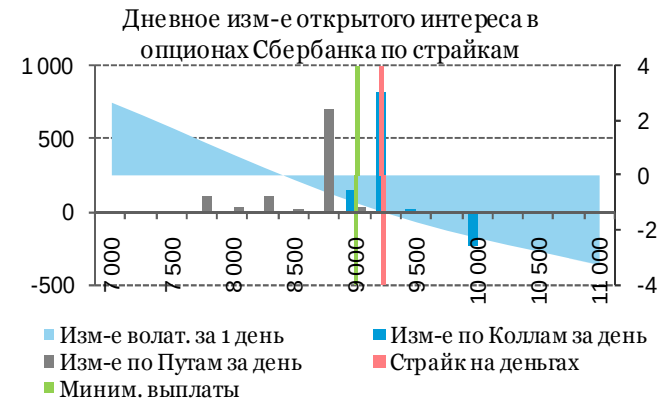
Недельное изменение открытого интереса в опционах Лукойла по страйкам

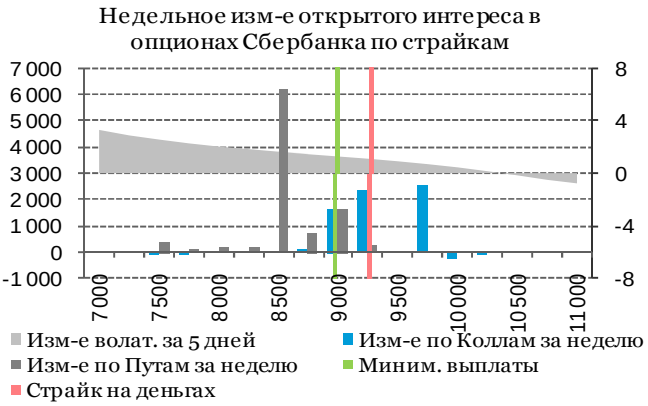


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ СБЕРБАНКА

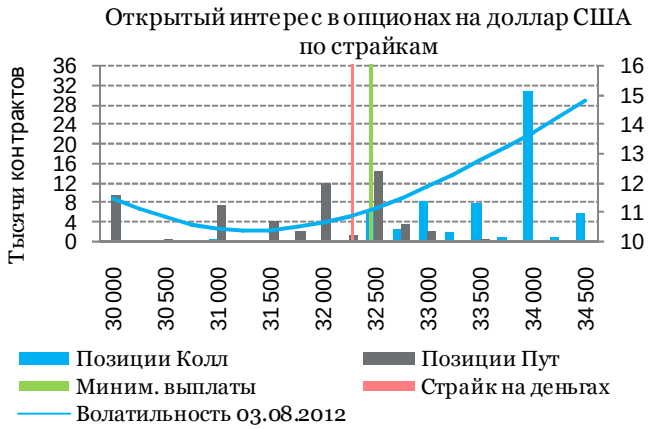


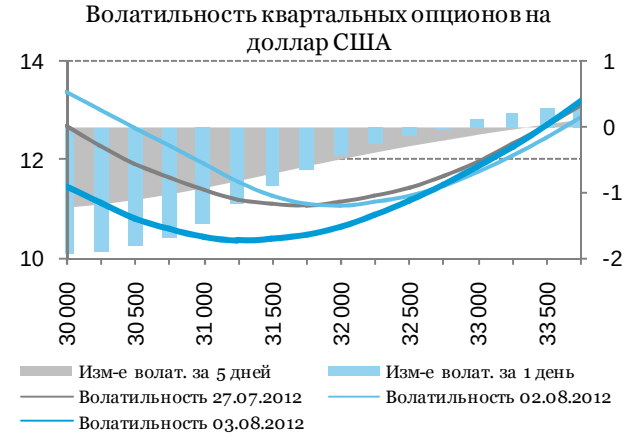


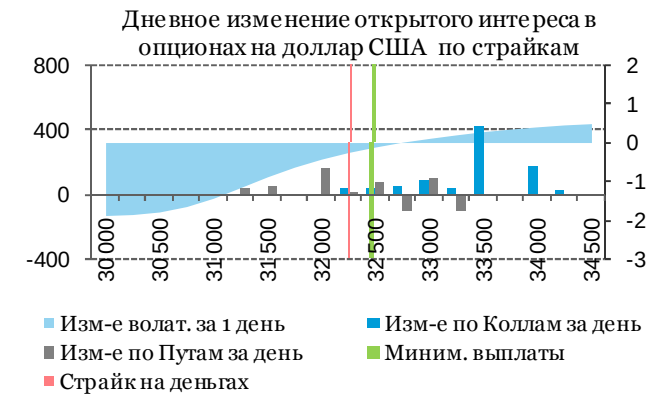


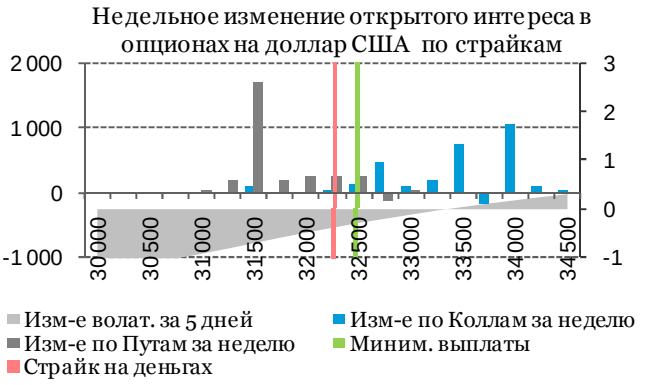


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ДОЛЛАР США



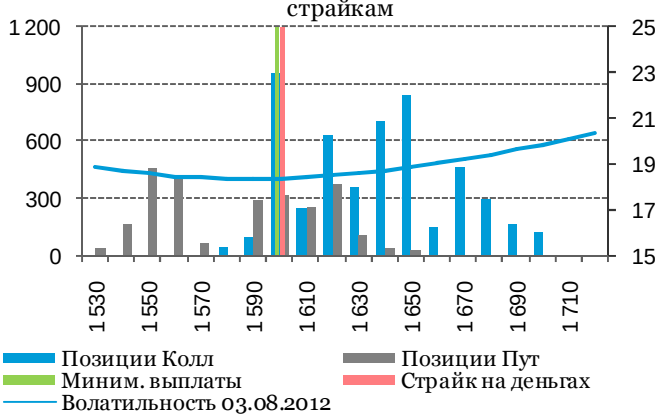




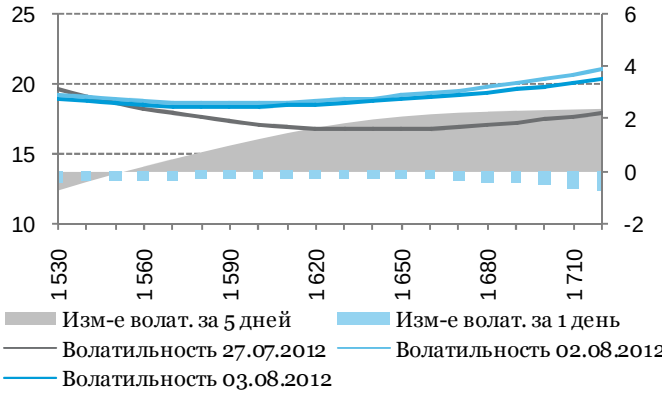


ОТКРЫТЫЙ ИНТЕРЕС В ОПЦИОНАХ НА ЗОЛОТО

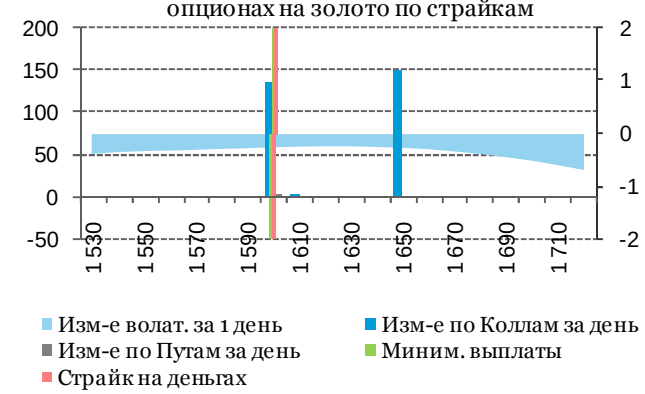
Открытый интерес в опционах на золото по страйкам



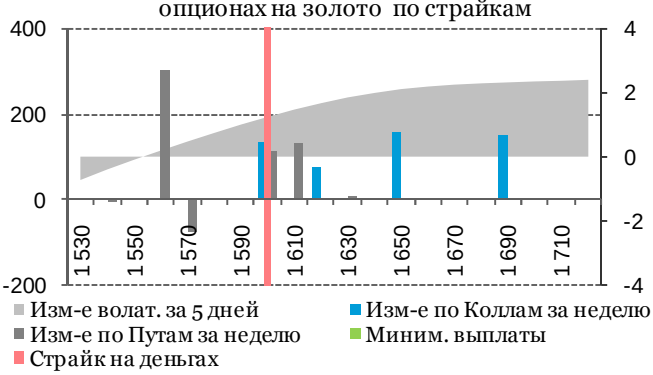
Волатильность квартальных опционов на золото



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.