

неделя с 5 по 9 июля 2010 года

8 июля 2010 года на рынке фьючерсов и опционов FORTS был введен в обращение опцион на фьючерс на курс евро-доллар. Данный инструмент стал пятым в линейке валютных контрактов FORTS. Его появление продиктовано стремлением участников торгов хеджировать рыночные риски вследствие текущей нестабильной ситуации в Еврозоне.

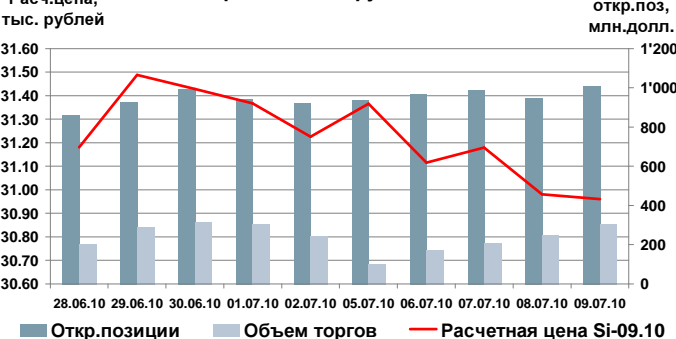
На прошедшей неделе с 5 июня по 9 июля продолжилось укрепление евро по отношению к доллару, при этом в контрактах на пару EUR/USD увеличился открытый интерес, объем открытых позиций за неделю увеличился на 11,86% до 119 232 контрактов или 130 млн.долларов США.

Среднедневной объем торгов фьючерсами на пару USD/RUB сократился на 23,83% и составил 205,1 тыс. контрактов или 205,4 млн. долларов США, объем открытых позиций при этом вырос и на закрытие 9 июля был равным 1,009 млрд. долларов США. В контрактах на пару EUR/RUB открытые позиции сократились на 6,7% до 53,56 тыс контрактов (67,74 млн. долларов США), среднедневной объем торгов также уменьшился на 8,2% и составил 2437 контрактов (3,08 млн. долларов США).

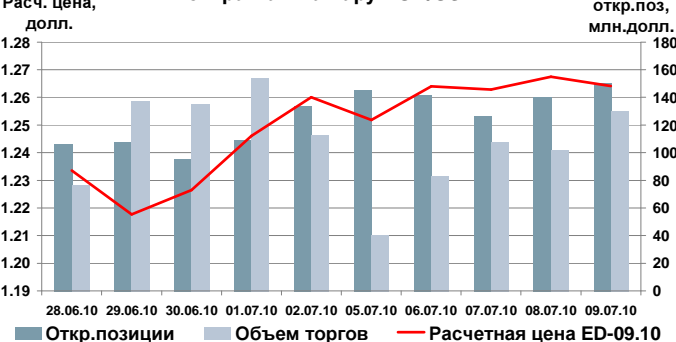
Александр Кирин, трейдер по операциям с производными финансовыми инструментами АКБ «ЦентроКредит»: «За неделю EUR укрепился на 4%, а с минимумов месяца на 6%. Технические индикаторы указывают на возможность усиления бычьего импульса в краткосрочной перспективе. Для дальнейшего роста паре необходимо удержаться выше 1,2500.

Российский рубль укрепился к корзине валют за неделю на 20 копеек на фоне повышения цены на нефть, что в свою очередь привело к снижению доходностей на валютных фьючерсах на 0,3%. В отсутствие негативного новостного фона мы ожидаем дальнейшего укрепления рубля, который находится у верхней линии понижающего канала».

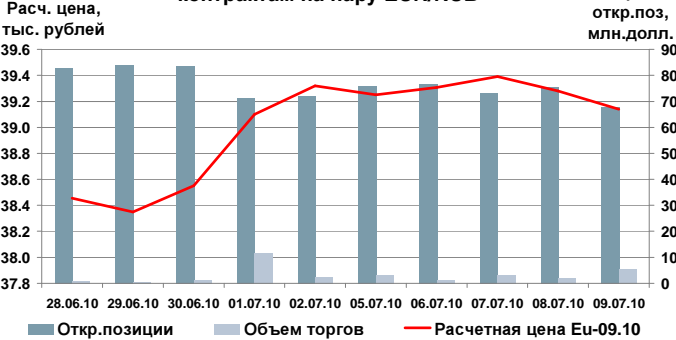
Динамика расчётной цены Si-09.10, суммарного объема торгов и открытых позиций по контрактам на пару USD/RUB



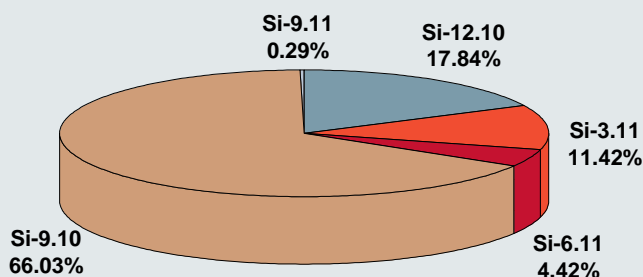
Динамика расчётной цены ED-09.10, суммарного объема торгов и открытых позиций по контрактам на пару EUR/USD



Динамика расчётной цены Eu-09.10, суммарного объема торгов и открытых позиций по контрактам на пару EUR/RUB



Доли по открытым позициям по контрактам на пару USD/RUR на 9 июля 2010 года



	5 - 9 июля				Среднедневной объём (все сроки)		Открытые позиции (все сроки) на 09.07.10	
	Open	Min	Max	Close	Рублей	Контрактов	Рублей	Контрактов
Si-09.10	31'232	30'862	31'375	30'960	6'382'162'276	205'107	31'222'665'520	1'003'788
ED-09.10	1.2603	1.2513	1.2722	1.2641	2'874'680'919	73'464	4'655'401'825	119'232
Eu-09.10	39'250	39'112	39'400	39'140	95'683'819	2'437	2'096'378'720	53'560