

неделя с 12 по 16 июля 2010 года

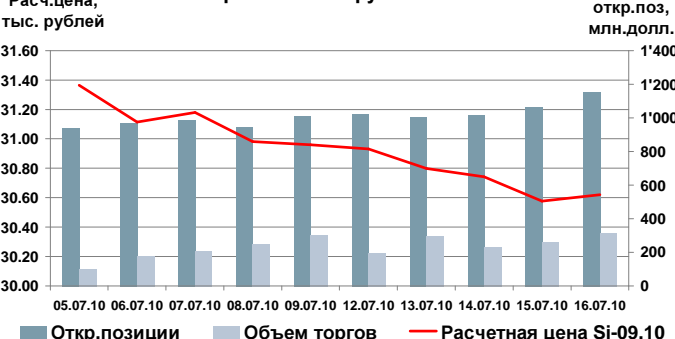
На прошедшей неделе с 12 по 16 июля наблюдался рост открытого интереса во всех трех контрактах на валютные пары на фоне укрепления евро к доллару США и российскому рублю. Так, во фьючерсах на пару **USD/RUB** суммарный объем открытых позиций вырос на 14% до 1,14 млн. контрактов (1,15 млрд. долларов США), а в контрактах на пары **EUR/USD** и **EUR/RUB** - на 19% - до 142 тыс. контрактов (183 млн. долларов США) и 64 тыс. контрактов (83 млн. долларов США) соответственно. Активность участников во фьючерсных контрактах на пару **EUR/USD** при этом сильно увеличилась – средневзвешенный объем торгов вырос почти в 2 раза и составил 179 млн. долларов США или 122,5 тыс. контрактов.

Александр Кирин, трейдер по операциям с производными финансовыми инструментами АКБ «ЦентроКредит»:

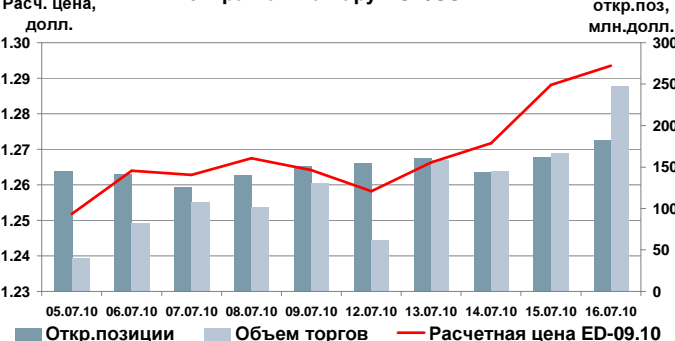
«За прошедшую неделю российский рубль укреплялся к корзине валют с 34,50 до 34,30, следуя за нефтью, цена на которую, в свою очередь, подрастала до 77 долларов (сорт Brent). Однако к концу недели котировки вернулись к прежним уровням, рубль потерял около 20 копеек и вернулся к уровню начала прошлой недели. Хотя торги на валютном рынке за прошедшую неделю были довольно слабые, это не помешало вырасти объему открытых позиций в сентябрьском контракте **USD/RUB** на 19%.

Инвесторы продают доллары и покупают евро из-за ослабления беспокойства по поводу долговых проблем Еврозоны и опасений замедления экономики США. После того как **EUR/USD**, вследствие улучшения ситуации на рынках Еврозоны и закрытия стопов в коротких позициях, достигла ключевых уровней сопротивления на уровне 1,30, перспектива пары выглядит достаточно оптимистично. Однако, не следует забывать, что 23 июля состоится публикация результатов стресс-тестов европейских банков и в случае негативной информации может произойти разворот вниз».

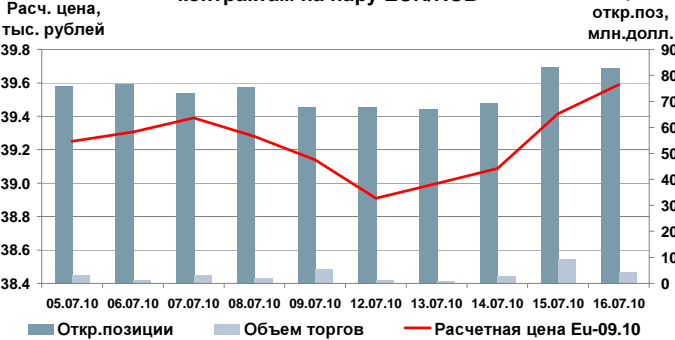
Динамика расчётной цены Si-09.10, суммарного объема торгов и открытых позиций по контрактам на пару USD/RUB



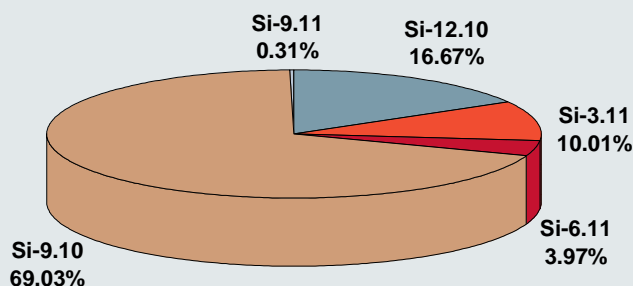
Динамика расчётной цены ED-09.10, суммарного объема торгов и открытых позиций по контрактам на пару EUR/USD



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 16 июля 2010 года



	12 - 16 июля				Средневзвешенный объём (все сроки)		Открытые позиции (все сроки) на 16.07.10	
	Open	Min	Max	Close	Рублей	Контрактов	Рублей	Контрактов
Si-09.10	30'937	30'492	31'029	30'620	7'932'337'027	257'999	35'187'444'910	1'144'422
ED-09.10	1.2638	1.2526	1.3005	1.2935	4'782'642'431	122'532	5'590'678'354	142'232
Eu-09.10	38'910	38'807	39'666	39'590	110'431'259	2'817	2'533'781'988	64'000