

неделя с 12 апреля по 16 апреля 2010 года



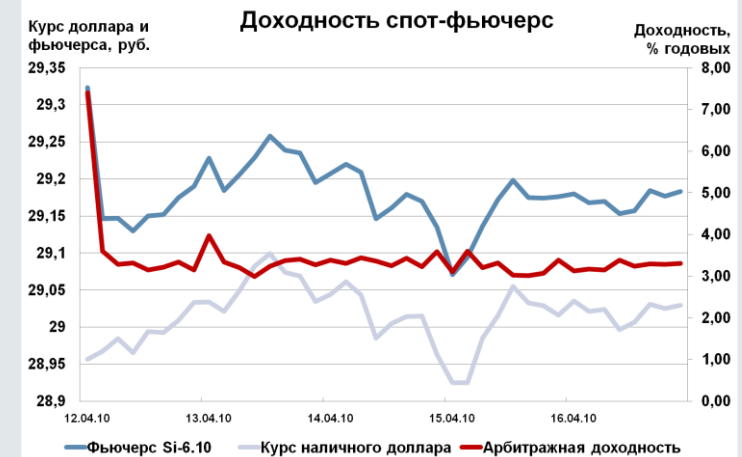
По итогам торгов минувшей недели с 12 по 16 апреля фьючерсный контракт [Si-6.10](#) на курс американской валюты на фоне достижения нефтью 1,5 годовых максимумов снизился с 29,381 до 29,175 рублей за 1 доллар США, что на 0,7011% ниже уровня закрытия предыдущей пятницы – 9 апреля.

Инвесторы незначительно сократили объём открытых позиций – открытый интерес снизился на 4,02% до 378 054 контрактов (11 029 725 450 рублей). Всего за прошедшую неделю было заключено 40 352 сделки общим объёмом 537 045 контрактов. Объём торгов в рублёвом эквиваленте составил более 15 млрд. рублей (или 0,54 млрд. долларов США).



Разница (контанго) между фьючерсом и спот рынком за неделю изменялась от 14 до 36 копеек, что делало доступным безрисковый арбитраж с доходностью от 2,99% до 7,4% годовых.

Спред между июньским (29,17) и [сентябрьским](#) (29,43) расчётным контрактом составляет 26 копеек, между июньским и [декабрьским](#) (29,75) 58 копеек.



	12 - 16 апреля				Среднедневной объём		Открытые позиции на 16.04.10	
	Open	Min	Max	Close	Рублей	Контрактов	Рублей	Контрактов
Si-6.10	29 407	29 039	29 444	29 175	3 133 570 572	107 409	11 029 725 450	378 054
ED-6.10	1,345	1,3442	1,369	1,3523	2 336 849 534	59 156	9 123 026 821	233 186
Eu-6.10	39 492	39 401	39 860	39 499	88 029 698	2 220	1 436 341 636	36 364