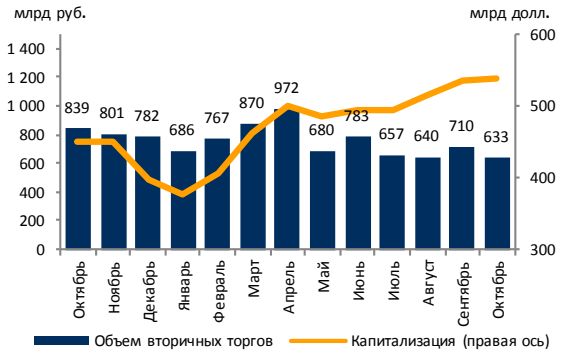
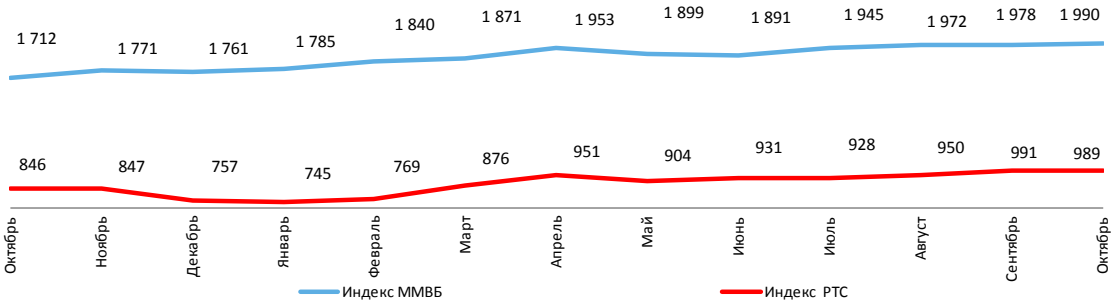
РЫНОК АКЦИЙ, РДР И ПАЕВ ПИФОВ

ОБЪЕМ ТОРГОВ АКЦИЯМИ, РДР И ПАЯМИ ПИФОВ



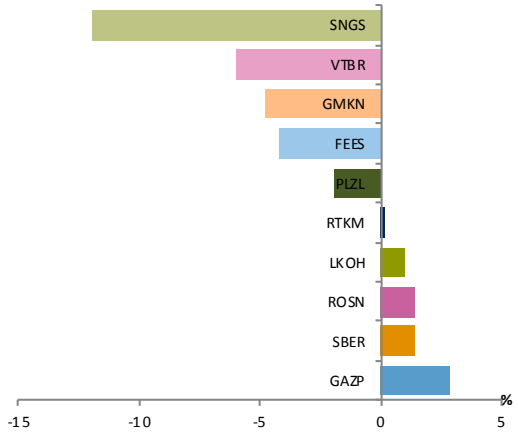
Объем биржевых торгов акциями за октябрь составил 632,6 млрд руб. Среднедневной объем торгов составил 30,1 млрд руб., что на 7% ниже уровня предыдущего месяца.
Доля сделок в секторе Т+ в объеме вторичных торгов акциями, ДР и паями составила 88%, на сектор Т0 пришлось 11%.

ИНДЕКСЫ ММВБ И РТС



В октябре Индекс ММВБ вырос на 0,6% до 1989,64 пунктов (1978 на конец сентября 2016 г.), долларовый Индекс РТС снизился на 0,2% до 988,74 пунктов (990,88 на конец сентября 2016 г.). Капитализация рынка акций за октябрь выросла на 4% и на последний день месяца составила 536,9 млрд долл. (534,8 млрд долл. на конец сентября 2016 г.).

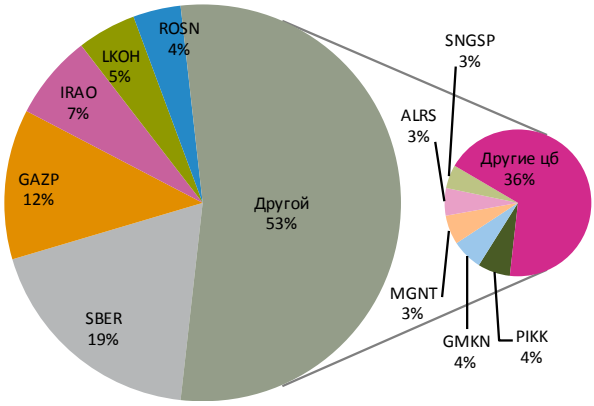
ИЗМЕНЕНИЕ ЦЕНЫ ЗАКРЫТИЯ «ГОЛУБЫХ ФИШЕК» ЗА МЕСЯЦ



Среди «голубых фишек» понизились цены обыкновенных акций
ОАО Сургутнефтегаз — на 12% (27,015 руб./акц.),
ПАО Банк ВТБ — на 6% (0,06775 руб./акц.),
ПАО ГМК «Нор. Никель» — на 4,8% (9344 руб./акц.),
ПАО ФСК ЕЭС — на 4,2% (0,171 руб./акц.),
ПАО Полюс Золото — на 1,9% (4400 руб./акц.),
повысились цены обыкновенных акций
ПАО Ростелеком — на 0,2% (79,01 руб./акц.),
ПАО НК ЛУКОЙЛ — на 1% (3100 руб./акц.),
ПАО Сбербанк России — на 1,4% (147,4 руб./акц.),
ОАО НК Роснефть — на 1,4% (347,65 руб./акц.),
ПАО Газпром — на 2,9% (138,84 руб./акц.).

Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

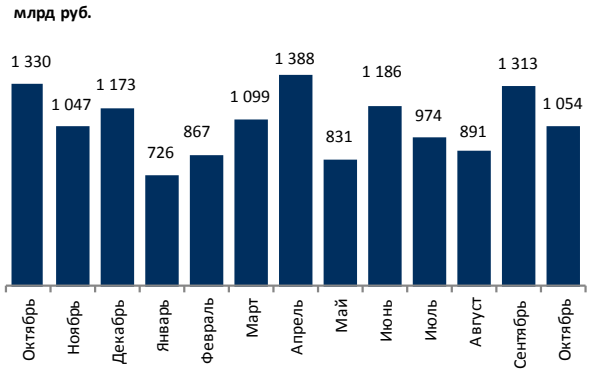
ЛИДЕРЫ ПО ОБЪЕМУ ТОРГОВ
НА РЫНКЕ АКЦИЙ, РДР И ПАЕВ ПИФОВ ЗА МЕСЯЦ



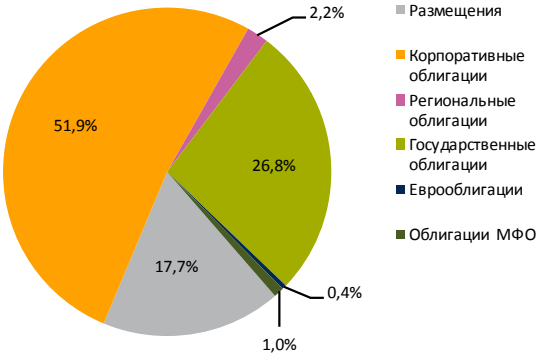
Лидерами по объему торгов стали акции ПАО «Сбербанк России» (SBER), объем торгов которыми составил 117,8 млрд руб. (19%), на втором месте обыкновенные акции ПАО «Газпром» (GAZP) — 77,4 млрд руб. (12%), на третьем месте обыкновенные акции ПАО «Интер» (IRAO) — 43,69 млрд руб. (7%), на четвертом месте обыкновенные акции ПАО «ЛУКОЙЛ» (LKOH) — 30,3 млрд руб. (5%), на пятом месте обыкновенные акции ПАО «Роснефть» (ROSN) — 24,7 млрд руб. (4%), на другие ценные бумаги пришлось 338,7 млрд руб. (53%).

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ, РЕГИОНАЛЬНЫХ, ГОСУДАРСТВЕННЫХ ОБЛИГАЦИЙ И ЕВРООБЛИГАЦИЙ

ОБЪЕМ ТОРГОВ
ОБЛИГАЦИЯМИ

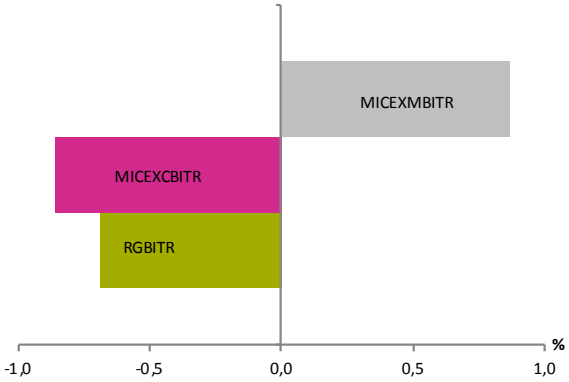


СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ
ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



Объем торгов облигациями за октябрь составил 1054 млрд руб. Среднедневной объем торгов составил 50 млрд руб., что на 16% ниже уровня предыдущего месяца. На долю корпоративных облигаций пришлось 546,7 млрд руб. (51,9% совокупного объема торгов), на долю региональных облигаций — 22,7 млрд руб. (2,2%), на долю государственных облигаций — 282,6 млрд руб. (26,8%), на долю еврооблигаций — 4,5 млрд руб. (0,4%), на долю облигаций МФО — 10,8 млрд руб. (1%). Объем размещений облигаций составил 186,7 млрд руб. (26,8%).

ИЗМЕНЕНИЕ ИНДЕКСОВ РЫНКА ОБЛИГАЦИЙ ЗА МЕСЯЦ



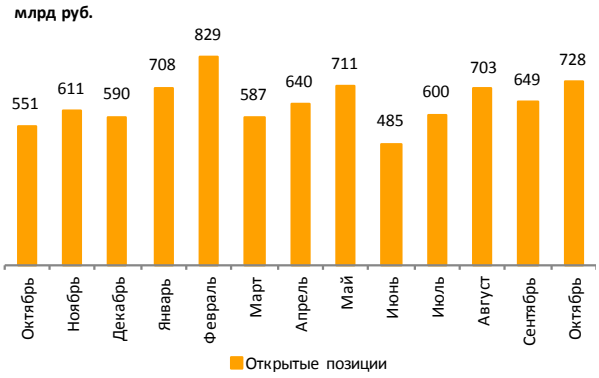
За месяц Индекс государственных облигаций (RGBITR) снизился на 0,7% до 402,94 (405,75 п. на конец сентября 2016 г.), индекс корпоративных облигаций MICEXCBITR (индекс чистых цен) снизился на 0,9% и составил 311,28 пунктов (313,97 п. на конец сентября 2016 г.), индекс муниципальных облигаций MICEXMBITR вырос на 0,9% и составил 218,62 пунктов (216,73 п. на конец сентября 2016 г.).

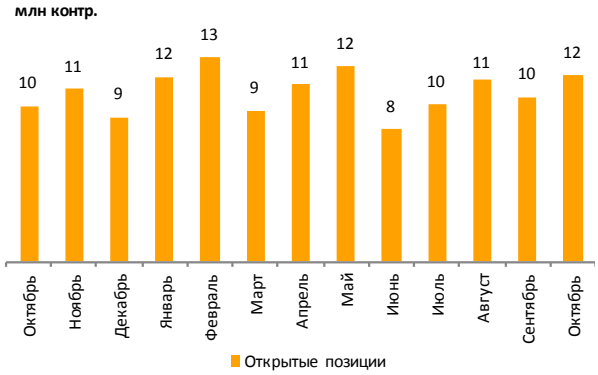
Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

СРОЧНЫЙ РЫНОК

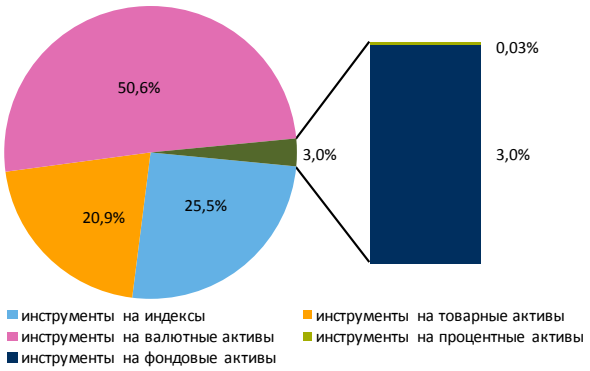
ОБЪЕМ ТОРГОВ
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

ОБЪЕМ ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ





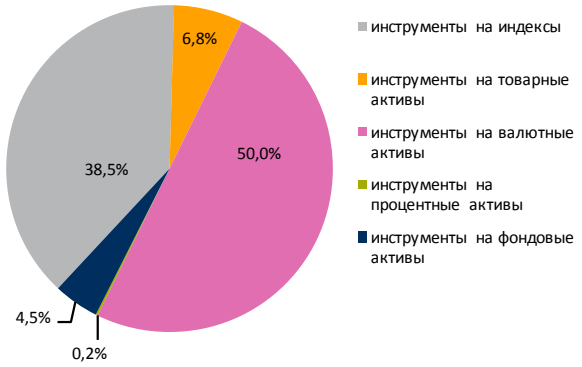
СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ
ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



На срочном рынке объем торгов за октябрь составил 7,2 трлн руб. или 132 млн контр. Среднедневной объем торгов составил 341,4 млрд руб., что на 22% ниже уровня предыдущего месяца. Объем открытых позиций на конец месяца составил 12 млн контр. или 728 млрд руб. На долю производных инструментов на индексы пришлось 1,8 трлн руб. (25,5% совокупного объема торгов), инструментов на фондовые активы — 215,9 млрд руб. (3,0%), инструментов на валютные активы — 3,6 трлн руб. (50,6%), инструментов на процентные активы — 2,3 млрд руб. (0,03%), инструментов на товарные активы — 1,5 трлн руб. (20,9%).

Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

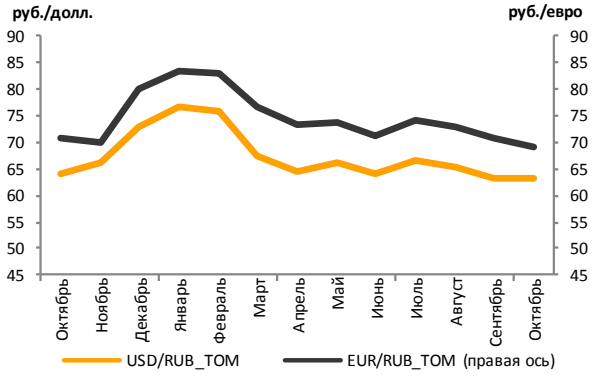
СТРУКТУРА ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ
НА КОНЕЦ МЕСЯЦА



Объем открытых позиций на конец месяца составил 728 млрд руб.:
Доля открытых позиций на валютные активы — 364 млрд руб. (50%),
на индексные инструменты — 280,4 млрд руб. (38,5%),
на товарные активы — 49,8 млрд руб. (6,8%),
на процентные активы — 1,5 млрд руб. (0,2%)
на фондовые активы — 32,7 млрд руб. (4,5%).

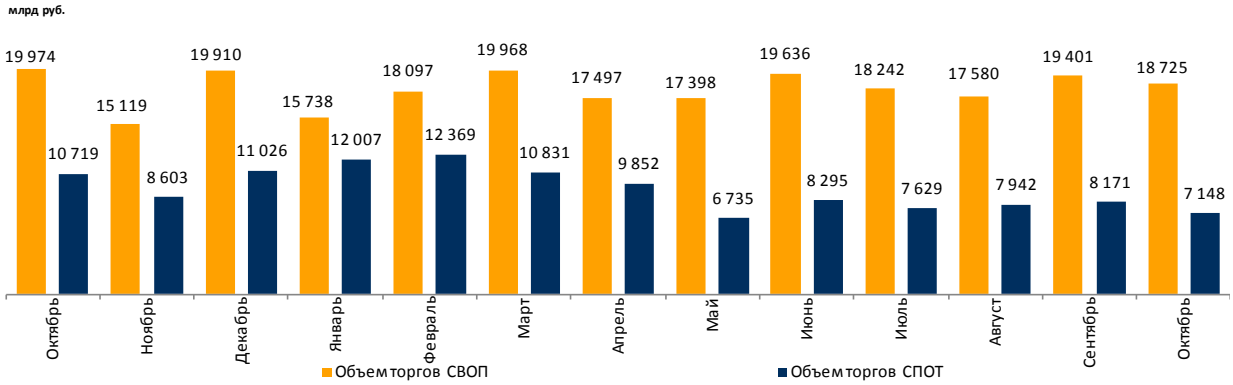
ВАЛЮТНО-ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

КУРСЫ ВАЛЮТ



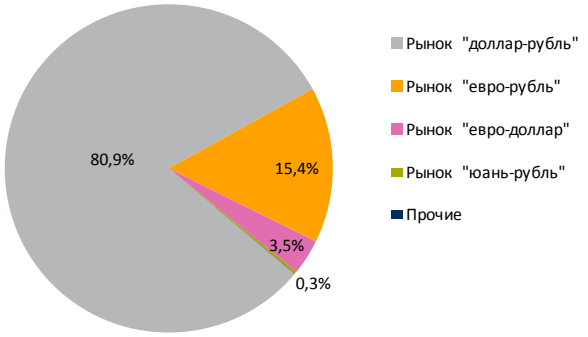
В октябре наблюдалось ослабление европейской валюты и укрепление американской. За месяц курс доллара расчетами «завтра» вырос на 0,05 руб. (0,1%) до 63,25 руб./долл., курс евро расчетами «завтра» снизился на 1,98 руб. (2,1%), составив на конец октября 2016 г. 69,26 руб./евро.

ОБЪЕМ ТОРГОВ
НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ



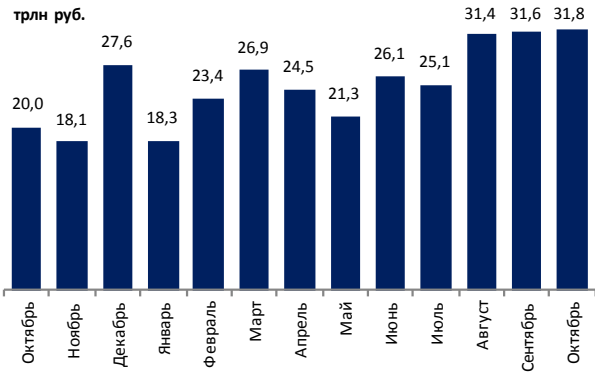
Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ

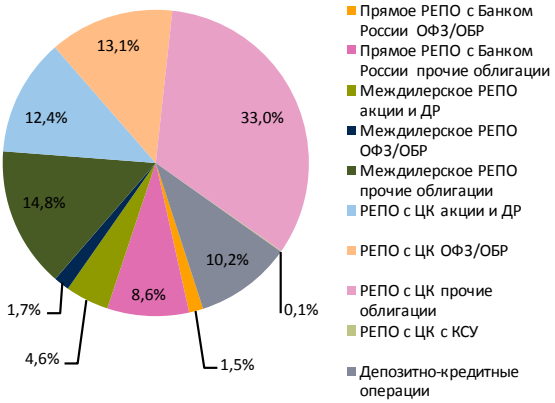


Объем торгов на валютном рынке за октябрь составил 25,9 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 1,23 трлн руб., что на 2% ниже уровня предыдущего месяца. На долю кассовых сделок пришлось 7,1 трлн руб. (27,6% совокупного объема торгов), на долю операций своп 18,7 трлн руб. (72,4%).
На долю операций «»доллар-рубль»» пришлось 20,9 трлн руб. (80,9% совокупного объема торгов), «евро-рубль» — 4 трлн руб. (15,4%), «евро-доллар» — 0,9 трлн руб. (3,5%), «юань-рубль» — 69 млрд руб. (0,3%), на прочие инструменты — 7,9 млрд руб.

ОБЪЕМ ТОРГОВ НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ



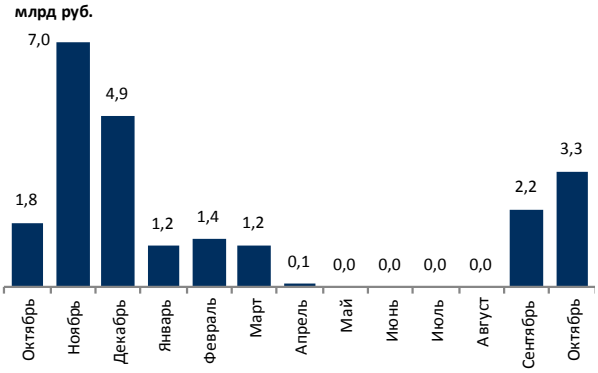
СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



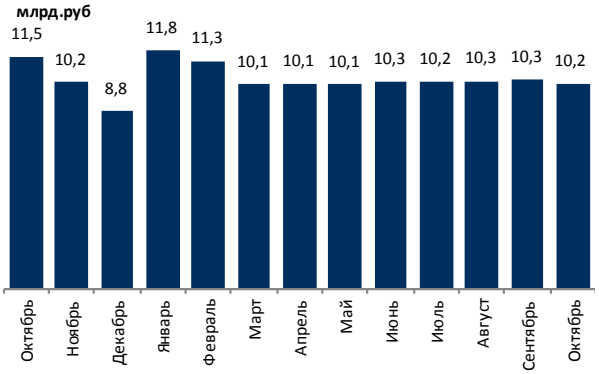
Объем торгов на денежном рынке за октябрь составил 31,8 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 1515 млрд руб., что на 5,4% выше уровня предыдущего месяца.
Доля операций прямого РЕПО с Банком России с ОФЗ/ОБР — 479,2 млрд руб. (1,5% совокупного объема торгов),
прямого РЕПО с Банком России с проч. облигациями — 2,7 трлн руб. (8,6% совокупного объема торгов),
междилерского РЕПО с акциями и РДР — 1,5 трлн руб. (4,6% совокупного объема торгов),
междилерского РЕПО с ОФЗ/ОБР — 526,3 млрд руб. (1,7% совокупного объема торгов),
междилерского РЕПО с проч. облигациями — 4,7 трлн руб. (14,8% совокупного объема торгов),
РЕПО с ЦК с акциями и РДР — 3,9 трлн руб. (12,4% совокупного объема торгов),
РЕПО с ЦК с ОФЗ/ОБР — 4,2 трлн руб. (13,1% совокупного объема торгов),
РЕПО с ЦК с проч. облигациями — 10,5 трлн руб. (33% совокупного объема торгов),
РЕПО с ЦК с КСУ — 29,4 млрд руб. (0,1% совокупного объема торгов),
депозитно-кредитных операций — 3,3 трлн руб. (10,2% совокупного объема торгов).

ТОВАРНЫЙ РЫНОК

ОБЪЕМ ТОРГОВ ЗЕРНОВЫМИ ИНТЕРВЕНЦИЯМИ



ОБЪЕМ ТОРГОВ ДРАГ. МЕТАЛЛАМИ



Объем торгов на товарном рынке составил 13,5 млрд руб. На долю драгоценных металлов пришлось 10,2 млрд руб. (76%), на долю зерновых интервенций пришлось 3,3 млрд руб (24%).

Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

Приложение 1

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА ОКТЯБРЬ 2016

	Октябрь		Сентябрь		Изменение объема торгов, %
	Объем торгов, млрд руб.	Число сделок, тыс. шт.	Объем торгов, млрд руб.	Число сделок, тыс. шт.	
Рынок акций, ДР и паев ПИФов					
Рынок Т+	550,2	7 842,1	691,4	8 387,2	–20,4
Рынок Т0	70,6	1,7	18,7	0,8	276,9
Размещения	11,7	1,1	0,0	0,0	–
Итого	**632,6**	**7 844,9**	**710,1**	**8 388,0**	**–10,9**
Рынок облигаций					
Корпоративные облигации	546,7	60,6	371,6	40,2	47,1
Региональные облигации	22,7	7,0	42,3	6,9	–46,3
Государственные облигации	282,6	48,3	541,4	38,1	–47,8
Еврооблигации	4,5	2,9	3,1	2,9	47,1
Облигации МФО	10,8	0,1	1,9	0,0	456,8
Размещения	186,7	0,9	352,5	1,2	–47,0
Итого	**1 053,9**	**119,8**	**1 312,8**	**89,4**	**–19,7**
Срочный рынок					
Инструменты на индексы	1 826,5	4 743,2	2 609,0	6 730,7	–30,0
Инструменты на фондовые активы	215,9	2 579,7	339,6	3 625,5	–36,4
Инструменты на валютные активы	3 627,2	9 612,5	4 918,0	13 972,7	–26,2
Инструменты на процентные активы	2,3	1,2	0,5	0,8	340,4
Инструменты на товарные активы	1 497,2	3 235,3	1 863,3	4 018,8	–19,7
Итого	**7 169,0**	**20 171,9**	**9 730,5**	**28 348,5**	**–26,3**
Валютный рынок					
Доллар-рубль (спот)	6 203,2	1 020,7	7 265,9	1 428,9	–14,6
Евро-рубль (спот)	825,4	195,1	783,4	175,1	5,4
Евро-доллар (спот)	102,8	6,0	103,5	4,0	–0,7
Юань-рубль (спот)	11,2	5,7	8,5	3,2	31,4
Прочее (спот)	5,1	2,1	9,7	1,5	–48,0
Доллар-рубль (своп)	14 716,9	146,5	15 032,3	144,9	–2,1
Евро-рубль (своп)	3 149,0	34,6	3 500,0	30,1	–10,0
Евро-доллар (своп)	798,7	2,1	811,1	2,1	–1,5
Юань-рубль (своп)	57,9	1,3	56,9	1,4	1,6
Прочее (своп)	2,9	1,3	0,7	1,1	331,1
Свопы	18 725,4	185,8	19 401,0	179,7	–3,5
Споты	7 147,6	1 229,6	8 171,0	1 612,8	–12,5
Итого	**25 873,0**	**1 415,5**	**27 572,0**	**1 792,5**	**–6,2**
Денежный рынок					
Прямое РЕПО с Банком России акции и ДР	0,0	0,0	0,0	0,0	–
Прямое РЕПО с Банком России ОФЗ/ОБР	479,2	1,9	539,4	1,6	–11,2
Прямое РЕПО с Банком России прочие облигации	2 744,2	5,9	3 888,4	6,3	–29,4
Междилерское РЕПО акции и ДР	1 460,7	42,6	1 221,5	43,5	19,6
Междилерское РЕПО ОФЗ/ОБР	526,3	1,2	618,6	1,3	–14,9
Междилерское РЕПО прочие облигации	4 719,7	13,6	4 095,5	12,7	15,2
РЕПО с ЦК акции и ДР	3 934,3	46,3	4 336,3	47,7	–9,3
РЕПО с ЦК ОФЗ/ОБР	4 182,2	13,5	4 531,2	13,9	–7,7
РЕПО с ЦК прочие облигации	10 499,5	19,2	8 460,9	19,0	24,1
РЕПО с ЦК с КСУ	29,4	0,5	28,1	0,5	4,7
Депозитно-кредитные операции	3 239,9	4,1	3 891,8	4,3	–16,8
Итого	**31 815,3**	**148,7**	**31 611,6**	**150,7**	**0,6**
Товарный рынок					
Рынок драгоценных металлов	10,2	0,00	10,3	0,00	–1,6
Интервенции	3,3	0,35	2,2	0,12	48,5
Споты	0,0	0,00	0,0	0,00	–
Итого	**13,5**	**0,4**	**12,6**	**0,1**	**7,2**
Рынок стандартизированных ПФИ	**0,0**	**0,0**	**0,0**	**0,0**	**–**
Общий объем торгов	**66 557,1**	**29 701,1**	**70 949,6**	**38 769,0**	**–6,2**

Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.

Приложение 2

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА ОКТЯБРЬ 2016

	Значение, пункты		Изменение, %	Изменение с начала года, %
	Октябрь	Сентябрь		
Индексы акций				
Основные индексы акций:				
Индекс ММВБ (MICEXINDEXCF)	1 989,64	1 978,00	0,59	12,83
Индекс РТС (RTSI)	988,74	990,88	–0,22	28,47
Индекс голубых фишек (RTSSTD)	13 012,00	12 924,39	0,68	11,61
Индекс второго эшелона (MICEXSC)	5 318,84	4 806,85	10,65	51,80
Индекс широкого рынка (MICEXBMI)	1 414,33	1 402,70	0,83	13,58
Отраслевые индексы:				
Нефть и газ (MICEXO&G)	4 905,32	4 838,37	1,38	6,11
Электроэнергетика (MICEXPWR)	1 697,93	1 678,46	1,16	81,60
Потребительский сектор (MICEXCGS)	6 704,39	6 866,93	–2,37	–0,37
Телекоммуникации (MICEXTLC)	1 588,13	1 607,14	–1,18	–6,29
Машиностроение (MICEXMNF)	1 613,97	1 685,01	–4,22	9,97
Финансы (MICEXFNL)	7 420,45	7 720,13	–3,88	16,53
Химия и нефтехимия (MICEXCHM)	13 898,80	14 349,28	–3,14	1,51
Металлы и добыча (MICEXM&M)	5 169,83	4 828,76	7,06	37,39
Транспорт (MICEXTRN)	1 689,28	1 502,01	12,47	95,59
Тематические индексы:				
ММВБ10 (MICEX10INDEX)	4 465,60	4 477,77	–0,27	13,23
Индекс ММВБ Инновации (MICEXINNOV)	386,14	363,97	6,09	25,78
Индекс РТС Сибирь (RTSSIB)	817,59	773,32	5,72	60,30
Индексы облигаций				
Индекс государственных облигаций (RGBITR)	402,94	405,75	–0,69	12,18
Индекс корпоративных облигаций (MICEXCBITR)	311,28	313,97	–0,86	9,83
Индекс муниципальных облигаций (MICEXMBITR)	218,62	216,73	0,87	10,29
Индексы активов пенсионных накоплений				
Консервативный (RUPCI)	2 024,77	2 007,86	0,84	9,17
Сбалансированный (RUPMI)	1 802,24	1 788,97	0,74	9,96
Агрессивный (RUPAI)	1 590,50	1 580,36	0,64	11,07
Индикатор срочного рынка:				
Индекс волатильности (RTSVX)	22,89	24,74	–7,48	–32,95

Наименование	Значение, руб./единица валюты		Изменение, %	Изменение с начала года, %
	31 окт	30 сен		
Курсы валют				
Доллар-рубль	63,25	63,20	0,1	–13,4
Евро-рубль	69,26	70,72	–2,1	–13,3
Юань-рубль	9,32	9,49	–1,8	–16,2

Представленная вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления. Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках. (495) 363-32-32, info@moex.com, moex.com.