

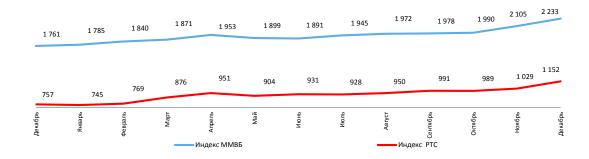
РЫНОК АКЦИЙ, РДР И ПАЕВ ПИФОВ

ОБЪЕМ ТОРГОВ АКЦИЯМИ, РДР И ПАЯМИ ПИФОВ



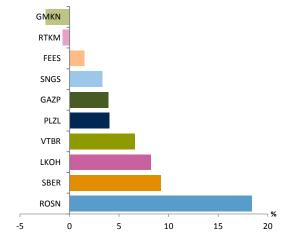
Объем биржевых торгов акциями за декабрь составил 983 млрд руб. Среднедневной объем торгов составил 44,7 млрд руб., что на 4,7% выше уровня предыдущего месяца. Доля сделок в секторе Т+ в объеме вторичных торгов акциями, ДР и паями составила 98%, на сектор Т0 пришлось 2%.

ИНДЕКСЫ ММВБ И РТС



В декабре Индекс ММВБ вырос на 6% до 2232,72 пунктов (2104,91 на конец ноября 2016 г.), долларовый Индекс РТС вырос на 12% до 1152,33 пунктов (1029,05 на конец ноября 2016 г.). Капитализация рынка акций за декабрь выросла на 13,5% и на последний день месяца составила 627,5 млрд долл. (552,7 млрд долл. на конец ноября 2016 г.).

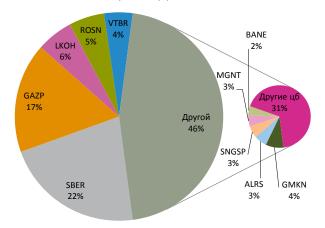
ИЗМЕНЕНИЕ ЦЕНЫ ЗАКРЫТИЯ «ГОЛУБЫХ ФИШЕК» ЗА МЕСЯЦ



Среди «голубых фишек» понизились цены обыкновенных акций ПАО ГМК «Нор.Никель» — на 2,4% (10122 руб./акц.), ПАО Ростелеком — на 0,7% (84 руб./акц.), повысились цены обыкновенных акций ПАО ФСК ЕЭС — на 1,5% (0,2032 руб./акц.), ОАО Сургутнефтегаз — на 3,3% (30,95 руб./акц.), ПАО Газпром — на 3,9% (154,55 руб./акц.), ПАО Полюс Золото — на 4% (4431 руб./акц.), ПАО Банк ВТБ — на 6,6% (0,074 руб./акц.), ПАО НК ЛУКОЙЛ — на 8,2% (3449 руб./акц.), ПАО Сбербанк России — на 9,2% (173,25 руб./акц.), ОАО НК Роснефть — на 18,4% (402,8 руб./акц.).

ЛИДЕРЫ ПО ОБЪЕМУ ТОРГОВ

НА РЫНКЕ АКЦИЙ, РДР И ПАЕВ ПИФОВ ЗА МЕСЯЦ

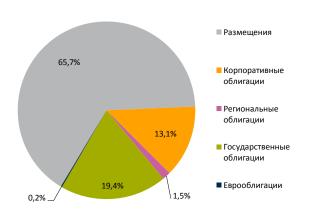


Лидерами по объему торгов стали акции ПАО «Сбербанк России» (SBER), объем торгов которыми составил 212,34 млрд руб. (22%), на втором месте обыкновенные акции ПАО «Газпром» (GAZP) — 167,45 млрд руб. (17%), на третьем месте обыкновенные акции ПАО «ЛУКОЙЛ» (LKOH) — 55,44 млрд руб. (6%), на четвертом месте обыкновенные акции ОАО «НК «Роснефть» (ROSN) — 54,17 млрд руб. (5%), на пятом месте обыкновенные акции ПАО банк «ВТБ» (VTBR) — 43,31 млрд руб. (4%), на другие ценные бумаги пришлось 449,9 млрд руб. (46%).

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ, РЕГИОНАЛЬНЫХ, ГОСУДАРСТВЕННЫХ ОБЛИГАЦИЙ И ЕВРООБЛИГАЦИЙ

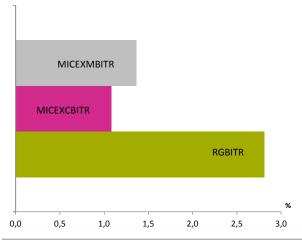
ОБЪЕМ ТОРГОВ ОБЛИГАЦИЯМИ

СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



Объем торгов облигациями за декабрь составил 2733 млрд руб. Среднедневной объем торгов составил 124,2 млрд руб., что на 74% выше уровня предыдущего месяца. На долю корпоративных облигаций пришлось 359 млрд руб. (13,1% совокупного объема торгов), на долю региональных облигаций — 41,4 млрд руб. (1,5%), на долю государственных облигаций — 530,3 млрд руб. (19,4%), на долю еврооблигаций — 5,5 млрд руб. (0,2%), на долю облигаций МФО — 1,1 млрд руб. (0,04%). Объем размещений облигаций составил 1795,8 млрд руб. (65,7%), рост объема обусловлен началом размещения однодневных облигаций.

ИЗМЕНЕНИЕ ИНДЕКСОВ РЫНКА ОБЛИГАЦИЙ ЗА МЕСЯЦ

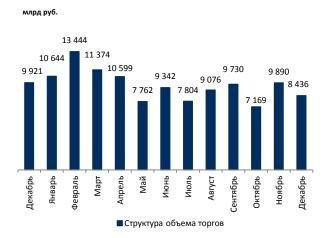


За месяц Индекс государственных облигаций (RGBITR) вырос на 2,8% до 413,58 (402,28 п. на конец ноября 2016 г.), индекс корпоративных облигаций МІСЕХСВІТР (индекс чистых цен) вырос на 1% и составил 316,32 пунктов (312,93 п. на конец ноября 2016 г.), индекс муниципальных облигаций МІСЕХМВІТР вырос на 1,4% и составил 222,71 пунктов (219,71 п. на конец ноября 2016 г.).

СРОЧНЫЙ РЫНОК

ОБЪЕМ ТОРГОВ

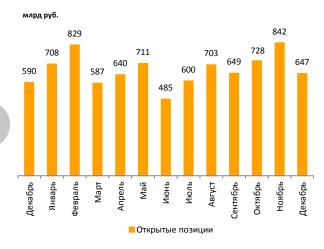
НА СРОЧНОМ РЫНКЕ

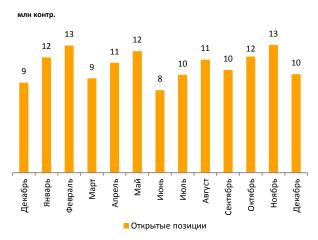




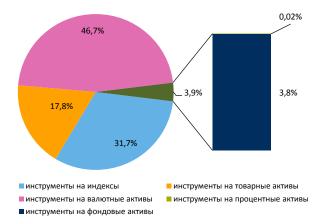
ОБЪЕМ ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ

НА СРОЧНОМ РЫНКЕ





СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



На срочном рынке объем торгов за декабрь составил 8,4 трлн руб. или 145 млн контр. Среднедневной объем торгов составил 383,5 млрд руб., что на 19% ниже уровня предыдущего месяца. Объем открытых позиций на конец месяца составил 10 млн контр. или 647 млрд руб. На долю производных инструментов на индексы пришлось 2,7 трлн руб. (31,7% совокупного объема торгов), инструментов на фондовые активы — 323,7 млрд руб. (3,8%), инструментов на валютные активы — 3,9 трлн руб. (46,7%), инструментов на процентные активы — 1,5 млрд руб. (0,02%), инструментов на товарные активы — 1,5 трлн руб. (17,8%).

СТРУКТУРА ОТКРЫТЫХ ПОЗИЦИЙ

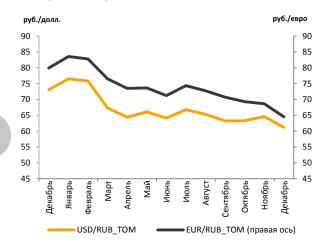
НА КОНЕЦ МЕСЯЦА



Объем открытых позиций на конец месяца составил 647 млрд руб.:
Доля открытых позиций на валютные активы — 309 млрд руб. (47,8%), на индексные инструменты — 266 млрд руб. (41,1%), на товарные активы — 44,9 млрд руб. (6,9%), на процентные активы — 0,7 млрд руб. (0,1%) на фондовые активы — 26,4 млрд руб. (4,1%).

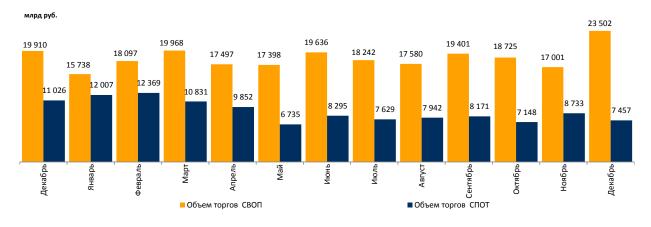
ВАЛЮТНО-ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

КУРСЫ ВАЛЮТ

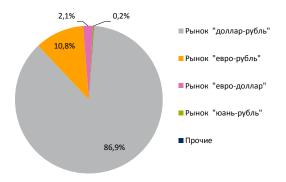


В декабре наблюдалось ослабление европейской и американской валюты. За месяц курс доллара расчетами «завтра» снизился на 3,47 руб. (5,4%) до 61,13 руб./долл., курс евро расчетами «завтра» снизился на 4,16 руб. (6,1%), составив на конец декабря 2016 г. 64,48 руб./евро.

ОБЪЕМ ТОРГОВ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ



СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ



Объем торгов на валютном рынке за декабрь составил 31 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 1,4 трлн руб., что на 14% выше уровня предыдущего месяца. На долю кассовых сделок пришлось 7,5 трлн руб. (24,1% совокупного объема торгов), на долю операций своп 23,5 трлн руб. (75,9%). На долю операций «доллар-рубль» пришлось 26,9 трлн руб. (86,9% совокупного объема торгов), «евро-рубль» — 3,3 трлн руб. (10,8%), «евро-доллар» —

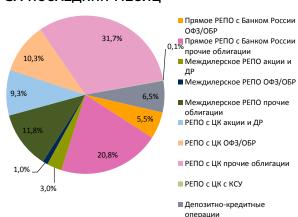
0,7 трлн руб. (2,1%), «юань-рубль» — 55,6 млрд руб. (0,2%),

ОБЪЕМ ТОРГОВ НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

трлн руб. 41,7 27,6 23,4 26,9 24,5 21,3 26,1 25,1 26,1 25,1 26,1 25,1 26,1 26,9 24,5 21,3 26,1 25,1 26,1 26,1 27,6 28,8 28,9

СТРУКТУРА ОБЪЕМА ТОРГОВ ЗА ПОСЛЕДНИЙ МЕСЯЦ

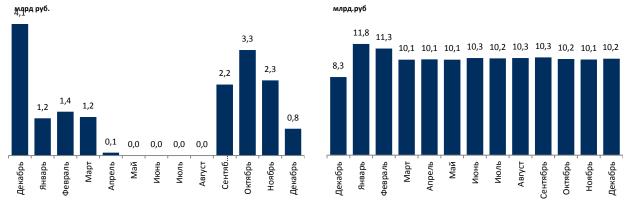
на прочие инструменты — 17,2 млрд руб.



Объем торгов на денежном рынке за декабрь составил 41,7 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 1896 млрд руб., что на 25,3% выше уровня предыдущего месяца. Доля операций прямого РЕПО с Банком России с ОФЗ/ОБР — 2289 млрд руб. (5,5% совокупного объема торгов), прямого РЕПО с Банком России с проч. облигациями — 8,7 трлн руб. (20,8% совокупного объема торгов), междилерского РЕПО с акциями и РДР — 1,3 трлн руб. (3,0% совокупного объема торгов), междилерского РЕПО с ОФЗ/ОБР — 436 млрд руб. (1% совокупного объема торгов), междилерского РЕПО с Проч. облигациями — 4,9 трлн руб. (11,8% совокупного объема торгов), РЕПО с ЦК с акциями и РДР — 3,9 трлн руб. (9,3% совокупного объема торгов), РЕПО с ЦК с ОФЗ/ОБР — 4,3 трлн руб. (10,3% совокупного объема торгов), РЕПО с ЦК с Проч. облигациями — 13,2 трлн руб. (31,7% совокупного объема торгов), РЕПО с ЦК с КСУ — 49,2 млрд руб. (0,1% совокупного объема торгов), депозитно-кредитных операций — 2,7 трлн руб. (6,5% совокупного объема торгов).

ТОВАРНЫЙ РЫНОК

ОБЪЕМ ТОРГОВ ЗЕРНОВЫМИ ИНТЕРВЕНЦИЯМИ ОБЪЕМ ТОРГОВ ДРАГ. МЕТАЛЛАМИ



Объем торгов на товарном рынке составил 11 млрд руб. На долю драгоценных металлов пришлось 10,2 млрд руб. (92%), на долю зерновых интервенций пришлось 0,8 млрд руб (8%).

Приложение 1

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА ДЕКАБРЬ 2016

	Декабрь		Ноябрь		Изменение
	Объем торгов,		Объем торгов,	Число сделок,	объема
	млрд руб.	тыс. шт.	млрд руб.	тыс. шт.	торгов, %
Рынок акций, ДР и паев ПИФов					
Рынок Т+	946.2	10 274,6	833,4	11 120,4	13,5
Рынок ТО	21,4	2,2	29,7	3,1	-27,9
Размещения	15,0	1,6	32,4	2,2	-53,6
Итого	982,6	10 278,4	895,5	11 125,7	9,7
Рынок облигаций					
Корпоративные облигации	359,2	59,7	282,7	46,2	27,0
Региональные облигации	41,4	11,7	41,7	9,5	-0,7
Государственные облигации	530,3	65,9	336,8	48,0	57,5
Еврооблигации	5,5	3,5	1,9	3,5	196,3
Облигации МФО	1,1	0,0	1,9	0,1	-40,1
Размещения	1 795,8	3,5	838,2	2,6	114,3
Итого	2 733,3	144,3	1 503,1	109,9	81,8
Срочный рынок					
Инструменты на индексы	2 672,7	6 326,0	2 374,0	6 039,4	12,6
Инструменты на фондовые активы	323,7	3 183,3	285,3	3 225,6	13,5
Инструменты на валютные активы	3 940,1	10 202,5	5 153,3	13 891,0	-23,5
Инструменты на процентные активы	1,5	1,4	2,8	1,2	-47,2
Инструменты на товарные активы	1 498,4	3 398,2	2 074,1	4 320,3	-27,8
Итого	8 436,4	23 111,3	9 889,6	27 477,5	-14,7
Валютный рынок					
Доллар-рубль (спот)	6 492,7	1 181,4	7 674,8	1 413,0	-15,4
Евро-рубль (спот)	798,0	203,6	890,5	216,1	-10,4
Евро-доллар (спот)	133,7	6,9	151,2	7,3	-11,6
Юань-рубль (спот)	17,0	5,9	13,5	4,3	25,9
Прочее (спот)	15,9	2,2	3,2	1,7	390,6
Доллар-рубль (своп)	20 408,2	152,0	13 560,5	129,6	50,5
Евро-рубль (своп)	2 530,1	36,4	2 836,2	32,5	-10,8
Евро-доллар (своп)	523,3	1,8	564,7	1,6	–7,3
Юань-рубль (своп)	38,6	1,5	37,9	1,6	1,7
Прочее (своп)	1,3	1,0	1,3	1,0	-3,0
Свопы	23 501,6	192,7	17 000,6	166,3	38,2
Споты	7 457,2	1 400,0	8 733,3	1 642,5	-14,6
Итого	30 958,9	1 592,6	25 733,9	1 808,8	20,3
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	2 288,9	1,2	480,7	1,3	376,2
Прямое РЕПО с Банком России прочие облигации	8 692,8	8,2	2 686,3	5,1	223,6
Междилерское РЕПО акции и ДР	1 266,7	42,2	1 304,9	41,3	-2,9
Междилерское РЕПО ОФЗ/ОБР	436,0	1,3	611,6	1,2	-28,7
Междилерское РЕПО прочие облигации	4 903,4	13,3	4 787,5	13,6	2,4
РЕПО с ЦК акции и ДР	3 873,3	50,7	3 856,3	47,7	0,4
РЕПО с ЦК ОФЗ/ОБР	4 302,1	14,1	4 002,1	13,7	7,5
РЕПО с ЦК прочие облигации	13 217,5	23,0	10 383,7	18,8	27,3
РЕПО с ЦК с КСУ	49,2	0,6	47,4	0,6	3,9
Депозитно-кредитные операции	2 693,5	4,5	3 625,6	4,5	-25,7
Итого	41 723,6	159,0	31 786,2	147,8	31,3
Товарный рынок					
Рынок драгоценных металлов	10,2	0,00	10,1	0,00	0,7
Интервенции	0,8	0,11	2,3	0,35	-64,4
Споты	0,0	0,00	0,0	0,00	
Итого	11,0	0,1	12,5	0,3	-11,5
Рынок стандартизированных ПФИ	1,8	0,0	1,1	0,0	67,1
Общий объем торгов	84 847,6	35 285,9	69 821,9	40 670,1	21,5

Приложение 2

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА ДЕКАБРЬ 2016

	Значение	Значение, пункты		Изменение с	
	Декабрь	Ноябрь	Изменение, %	начала года, %	
Индексы акций					
Основные индексы акций:					
Индекс ММВБ (MICEXINDEXCF)	2 232,72	2 104,91	6,07	26,62	
Индекс РТС (RTSI)	1 152,33	1 029,05	11,98	49,72	
Индекс голубых фишек (RTSSTD)	14 736,86	13 791,86	6,85	26,40	
Индекс второго эшелона (MICEXSC)	6 087,67	5 783,19	5,26	73,75	
Индекс широкого рынка (MICEXBMI)	1 588,33	1 497,49	6,07	27,55	
Отраслевые индексы:					
Нефть и газ (MICEXO&G)	5 690,32	5 246,28	8,46	23,09	
Электроэнергетика (MICEXPWR)	1 984,16	1 939,56	2,30	112,21	
Потребительский сектор (MICEXCGS)	6 781,37	6 787,62	-0,09	0,77	
Телекоммуникации (MICEXTLC)	1 754,08	1 624,22	8,00	3,50	
Машиностроение (MICEXMNF)	1 648,94	1 627,68	1,31	12,35	
Финансы (MICEXFNL)	8 347,87	7 787,28	7,20	31,09	
Химия и нефтехимия (MICEXCHM)	14 423,84	14 583,16	-1,09	5,34	
Металлы и добыча (MICEXM&M)	5 536,89	5 513,80	0,42	47,14	
Транспорт (MICEXTRN)	1 878,16	1 733,74	8,33	117,46	
Тематические индексы:					
MMB610 (MICEX10INDEX)	4 918,92	4 662,46	5,50	24,72	
Индекс ММВБ Инновации (MICEXINNOV)	386,92	400,32	-3,35	26,03	
Индекс РТС Сибирь (RTSSIB)	849,63	854,57	-0,58	66,58	
Индексы облигаций					
Индекс государственных облигаций (RGBITR)	413,58	402,28	2,81	15,14	
Индекс корпоративных облигаций (MICEXCBITR)	316,32	312,93	1,08	11,61	
Индекс муниципальных облигаций (MICEXMBITR)	222,71	219,71	1,37	12,35	
Индексы активов пенсионных накоплений					
Консервативный (RUPCI)	2 056,76	2 035,88	1,03	10,90	
Сбалансированный (RUPMI)	1 868,28	1 830,54	2,06	13,99	
Агрессивный (RUPAI)	1 689,74	1 635,83	3,30	18,00	
Индикатор срочного рынка:					
Индекс волатильности (RTSVX)	0,00	25,38	-100,00	-100,00	
	Значе	21110	Изменение, %	Изменение с начала года, %	
Наименование	руб./едини				
	30 дек	30 ноя			
Курсы валют					
Доллар-рубль	61,13	64,60	-5,4	-16,3	
Евро-рубль	64,48	68,64	-6,1	-19,3	
Юань-рубль	8,87	9,41	-5,8	-20,2	