

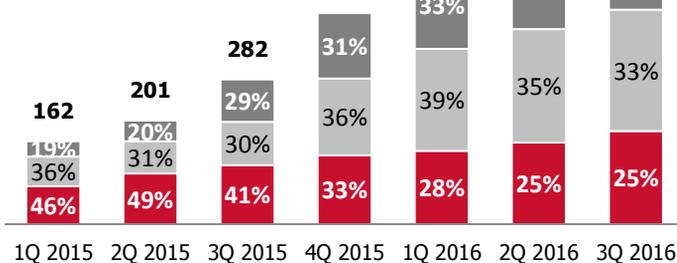


ДИНАМИКА НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

РЕПО с ЦК. Структура по типам инструментов

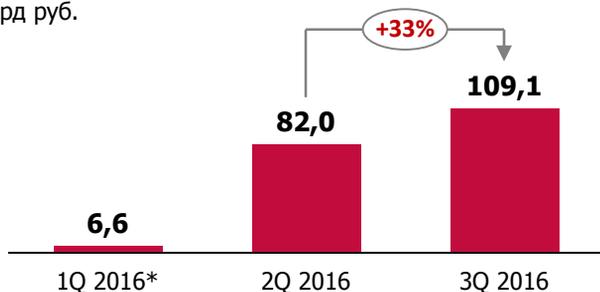
Среднедневной объем, млрд руб.

- Еврооблигации
- Облигации
- Акции



Объем торгов РЕПО с КСУ

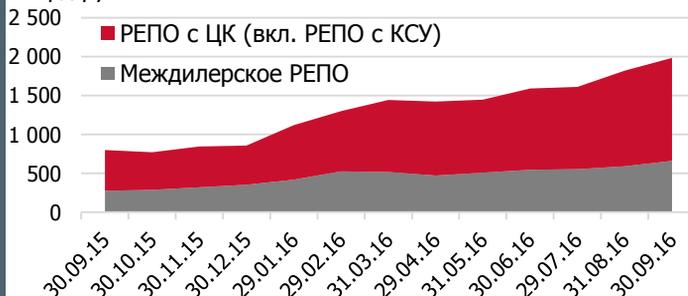
млрд руб.



*Запуск РЕПО с КСУ – 29 февраля 2016г.

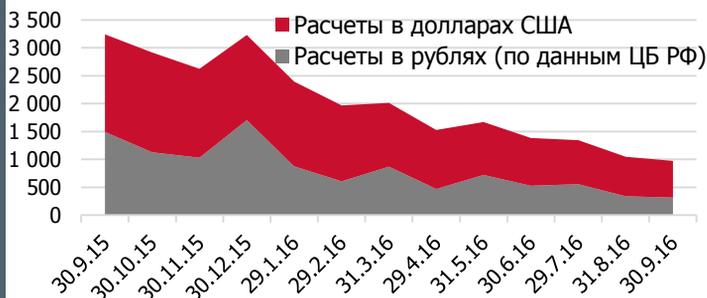
Объем открытых позиций

млрд руб.



Объем открытых позиций. РЕПО с Банком России

млрд руб.



Комментарии

- Совокупный объем торгов на Денежном рынке (РЕПО и депозитно-кредитные операции) в сентябре 2016 г. вырос на 77% до **31,6 трлн рублей** (17,9 трлн рублей в сентябре 2015 года), а среднедневной объем операций составил **1 436,9 млрд рублей**.
- Наилучшую динамику развития демонстрирует РЕПО с Центральным контрагентом, доля которого превысила **75%** от объема торгов междилерского РЕПО и РЕПО с ЦК.
- Объем торгов РЕПО с ЦК по итогам сентября достиг рекордного значения - **17,4 трлн руб.**, среднедневной объем торгов составил **788,9 млрд рублей**, в **2,4 раза** превысив аналогичный показатель предыдущего года.
- Объем операций РЕПО с клиринговыми сертификатами участия (КСУ) с момента запуска торгов 29 февраля превысил **197,7 млрд рублей**. К сектору рынка подключились 62 участника.
- Растет популярность операций РЕПО с ЦК в иностранной валюте, в сентябре объем торгов достиг **3,8 трлн рублей**, что на 12% больше значения августа.
- На депозиты коммерческих банков в рамках депозитных операций на Бирже в сентябре было размещено **3 891,8 млрд руб.**, что на **40%** превышает показатели сентября предыдущего года.
- Задолженность кредитных организаций перед Банком России по операциям РЕПО в рублях по состоянию на 17/10/2016г. составляет **128,1 млрд руб.** (по операциям на аукционной основе - 0 руб., по фиксированной ставке - 128,1 млрд руб.), по операциям РЕПО в иностранной валюте - \$9,9 млрд.

Структура Денежного рынка

Сентябрь, %

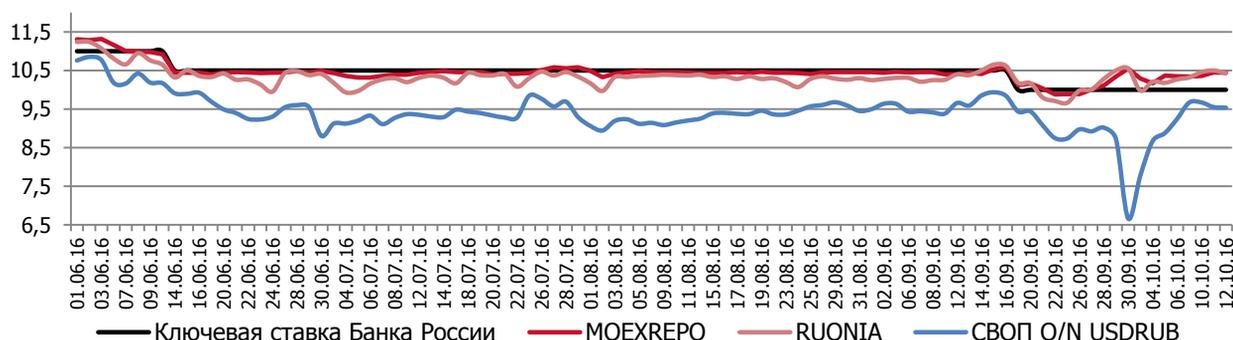


**включая операции РЕПО с СВО в НРД



ИНДИКАТОРЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА

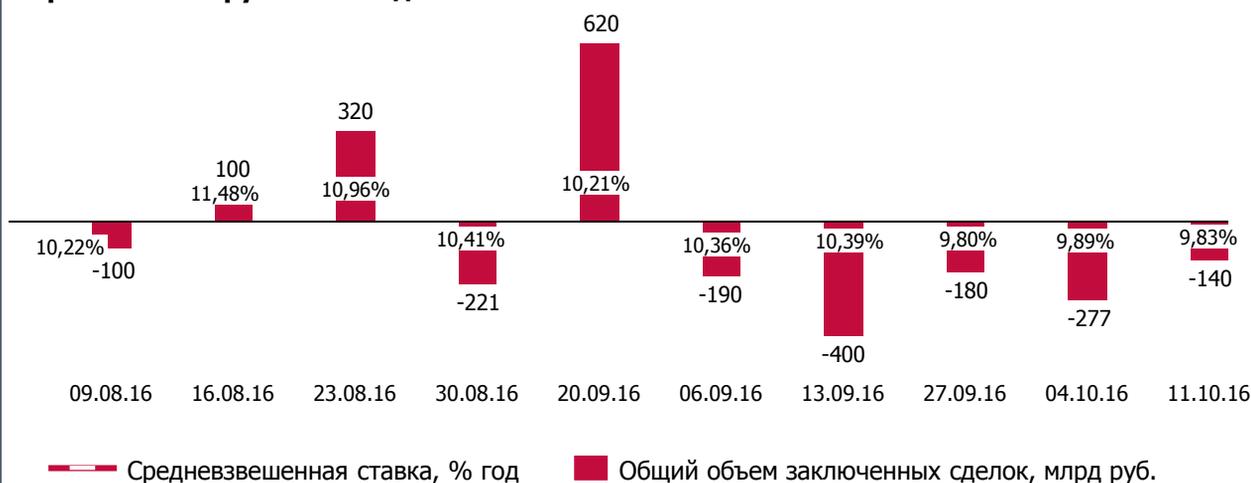
Индикаторы Денежного рынка (%)



По информации из официального [пресс-релиза Банка России](#): Совет директоров Банка России 16 сентября 2016 года принял решение снизить ключевую ставку до 10,00% годовых.

ОПЕРАЦИИ БАНКА РОССИИ*

Итоги Аукционов РЕПО и Депозитных аукционов Банка России с расчетами в рублях на 7 дней



Отрицательные значения – депозитные аукционы Банка России

СОБЫТИЯ

31 августа. Заочное заседание Комитета по РЕПО и кредитованию ценными бумагами

Об изменении тарифов при совершении сделок РЕПО с ЦК с расчетами в иностранной валюте.

[Решения, принятые Комитетом по РЕПО и кредитованию ценными бумагами 31.08.2016](#)

14 сентября. Заочное заседание Комитета по РЕПО и кредитованию ценными бумагами.

О рассмотрении вопросов и рекомендациях Наблюдательному совету ПАО Московская Биржа по утверждению внутренних документов в связи с реорганизацией ПАО Московская Биржа путем присоединения к нему ЗАО «ФБ ММВБ».

[Решения, принятые Комитетом по РЕПО и кредитованию ценными бумагами 14.09.2016](#)

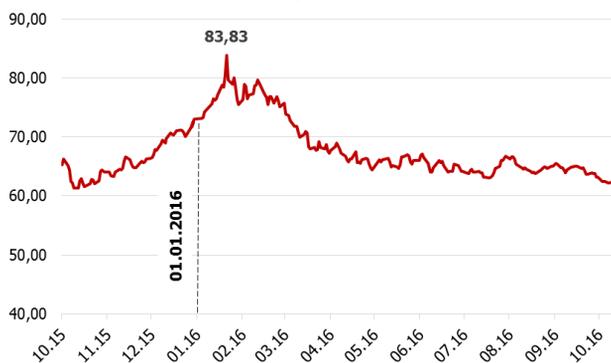
*Источник: Данные Банка России



ДИНАМИКА НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ

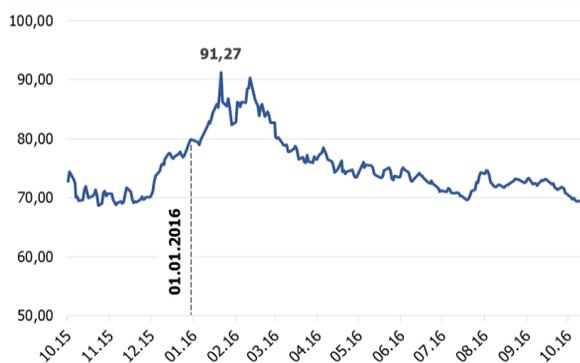
Динамика курса USD/RUB с расчетами завтра

IV кв. 2015 – III кв. 2016 (по дням)



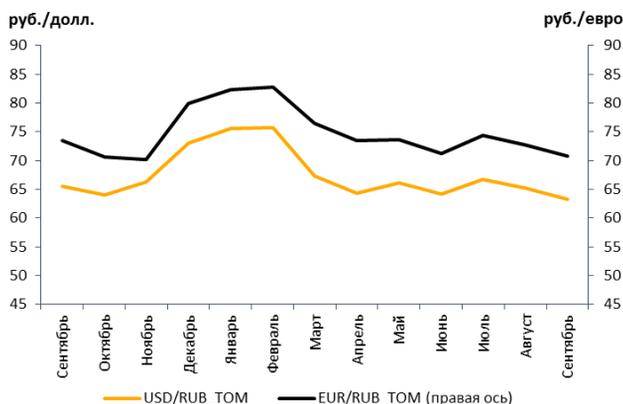
Динамика курса EUR/RUB с расчетами завтра

IV кв. 2015 – III кв. 2016 (по дням)



Динамика курсов USD/RUB и EUR/RUB

в 2015-2016 (по месяцам)

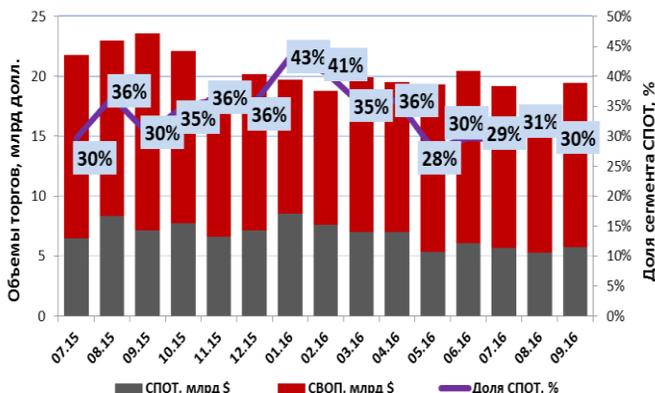


Комментарии

- В III кв. 2016 г. в связи с ростом цен на нефть марки Brent с 46 до 50 долл./баррель продолжилось постепенное укрепление курса рубля по отношению к доллару и евро.
- С 1 июля по 30 сентября 2016 г. средневзвешенный курс USD/RUB снизился на 83 коп. (-1,3%) до уровня 63,20 руб./долл., курс EUR/RUB уменьшился на 49 коп. (-0,7%) до уровня 70,72 руб./евро.

Средневзвешенный объем торгов и доля СПОТ

в 2015 - 2016 (по месяцам)



- Средневзвешенный объем торгов за III кв. 2016 г. составил **18,6 млрд долл.**, что на ~9% ниже средневзвешенного объема за 2015 г. (20,5 млрд долл.).
- По сравнению с 2015 г. выросла доля СПОТ операций в структуре объемов торгов (за 9 мес. 2016 г. соотношение СПОТ/СВОП составило **34/66**, в среднем за 2015 г. – 33/67).
- В III кв. 2016 г. структура рынка по валютным парам не претерпела существенных изменений: **84%** - USDRUB, **13,5%** - EURRUB, **2,5%** - прочие

Источник: данные Московской Биржи



ДИНАМИКА НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ

ОБЪЕМ ТОРГОВ НА ВАЛЮТНОМ РЫНКЕ МБ И ДОЛЯ БИРЖЕВОГО РЫНКА

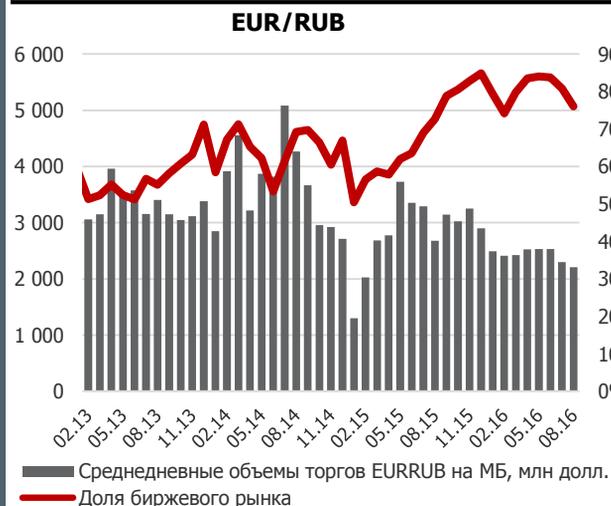
В общем объеме межбанковских операций



Комментарии

- За III кв. 2016 доля валютного рынка Московской биржи в межбанковских операциях российских банков увеличилась до **52,6%** по сравнению со средним за 2015 г. (49,2%)
- По операциям USDRUB доля достигла **61,0%** (в среднем за 2015 год – 58,1%)
- По операциям EURRUB доля увеличилась до **78,4%** (в среднем за 2015 год – 67,8%)
- По операциям EURUSD доля стабилизировалась на уровне **7,3%** (в среднем за 2015 год – 9,5%)

В общем объеме межбанковских операций



В общем объеме межбанковских операций



События

- **10 октября** запущены торги фиксированными своп контрактами по валютным парам USD/RUB, EUR/RUB, CNY/RUB. Торги будут проходить как в системном, так и во внесистемном режимах. Период между датами исполнения обязательств по второй части фиксированных своп контрактов – 3 месяца (квартал), максимальная глубина фиксированных своп контрактов – 1 год, по валютной паре юань/рубль – полгода (аналогично фиксированным поставочным фьючерсам). Размеры лотов 100 000 единиц валюты совпадают с фиксированными поставочными фьючерсами. Шаг цены – 0,0001 рубля (по китайским юаням – 0,000001 рубля).



КОНТАКТЫ

Сергей Титов

Зам. директора департамента рынка РЕПО
и депозитно-кредитных операций

Sergey.Titov@moex.com

+7(495) 363-32-32, доб. 26129

Александр Агеев

Зам. директора департамента
валютного рынка

Alexander.Ageev@moex.com

+7(495) 363-32-32, доб. 26241

РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ

Настоящий документ был подготовлен и выпущен Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММББ-ПТС» (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления. Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании. Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него. Настоящий документ содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящий документ заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных предположениях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие: • восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами; • волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (б) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность; • изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (б) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг; • ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России; • способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ; • способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности; • способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях; • способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях. Прогнозные заявления делаются только на дату настоящего документа.