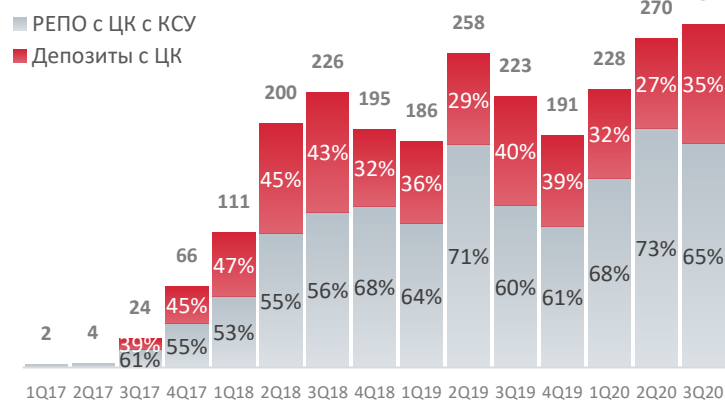
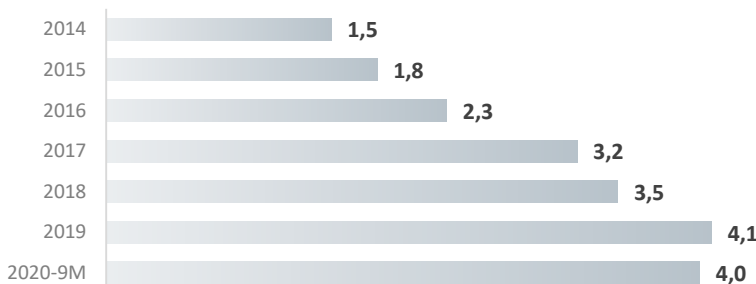


ДИНАМИКА НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

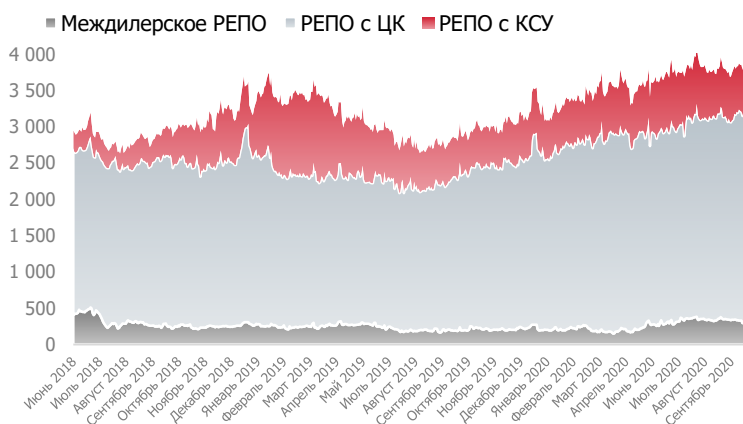
РЕПО с КСУ. Среднедневной объем торгов млрд руб.



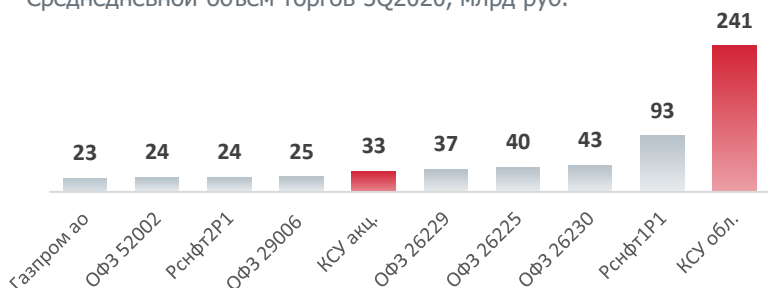
Средний срок РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) в календарных днях



Объем открытой позиции, млрд руб.



Топ-10 ценных бумаг в РЕПО с ЦК Среднедневной объем торгов 3Q2020, млрд руб.



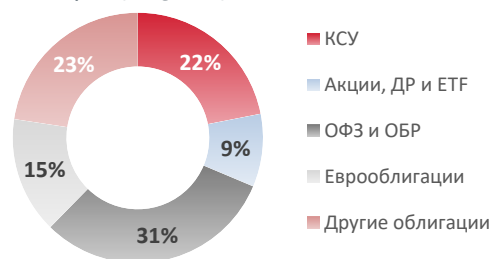
Комментарии

- Среднедневной объем торгов на Денежном рынке (РЕПО и депозитно-кредитные операции) составил – **1,72 трлн руб.**
- Средний срок РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) составил **3,9 дня**
- Среднедневная открытая позиция **РЕПО с ЦК** составила – **2,8 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция по **РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК)** составила **813,9 млрд руб.**
- Среднедневная открытая позиция по **операциям размещения средств Федерального казначейства через ЦК** составила **296,6 млрд руб.**
- Доля РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) в объеме биржевого рынка РЕПО - **83%**
- Доля РЕПО с КСУ в объеме биржевого рынка РЕПО – **18%**
- Среднедневной объем торгов в сегменте депозитно-кредитных операций составил **191 млрд руб.**

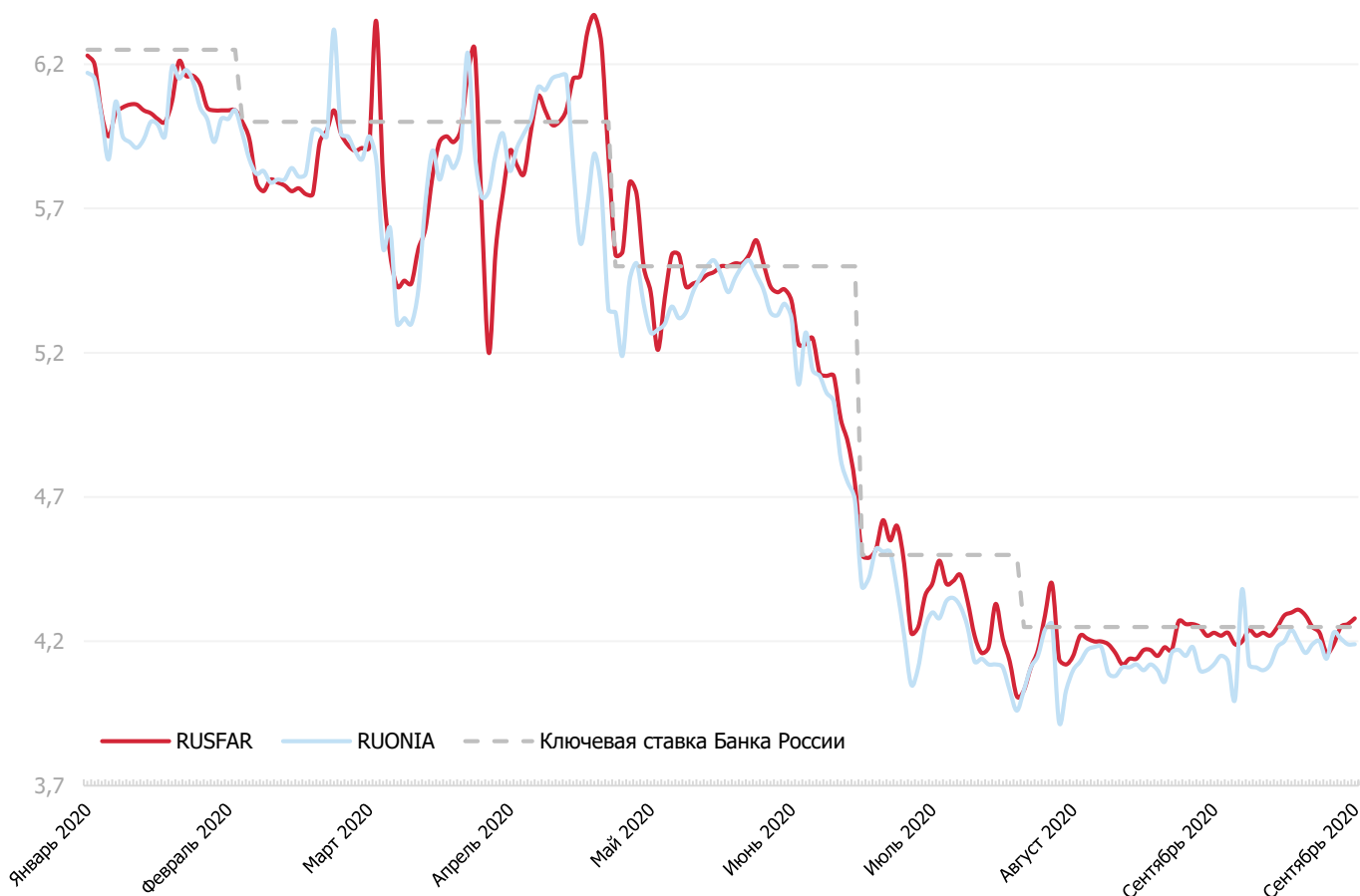
Данные за 3 квартал 2020 г.

Структура рынка РЕПО с ЦК

Объем торгов, 3Q2020, %



ИНДИКАТОРЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА



По информации из официального пресс-релиза: Совет директоров Банка России 18 сентября 2020 года принял решение сохранить ключевую ставку на уровне **4,25%** годовых.

СОБЫТИЯ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА

9 июля 2020 года:

- Банк России аккредитовал финансовый индикатор Московской Биржи – RUSFAR (в рублях срочностью овернайт, 1 неделя, 2 недели, 1 месяц и 3 месяца, в долларах США — срочностью овернайт).

С 28 сентября 2020 года:

- участникам денежного рынка предоставлена возможность заключения сделок РЕПО с ЦК в случае отсутствия информации о следующем купоне (неизвестный купон).

СОБЫТИЯ

Итоги **Euromoney FX Survey 2020**: FX MOEX вошел в TOP-15 среди мульти-дилерских платформ, в TOP-10 в номинации Best ECN, в TOP-5 в номинации Best post-trade

01.07 – по EURUSD_SPT в режиме «Рынок OTC Крупные сделки» (OTCF) доступно FULL AMNT исполнение на 1/2/5/10 млн €

17.08 – состоялся 16-й Съезд ACI Russia 2020. Участвовало ~60 членов офлайн и более 100 онлайн

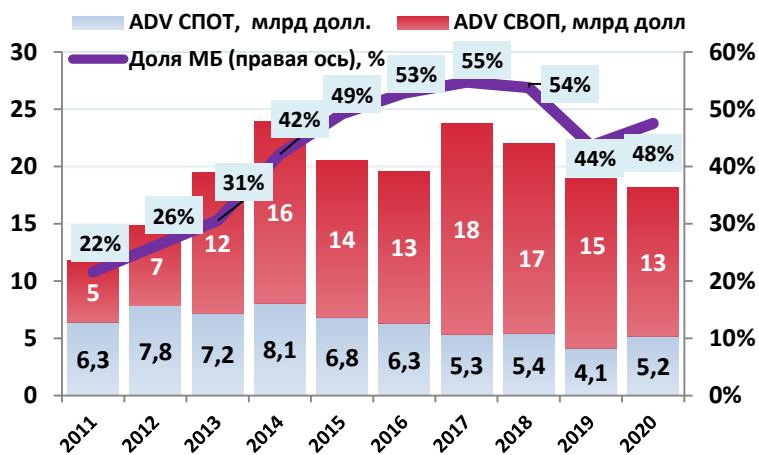
02.09 – тарифы по сделкам с фиксингом MOEX установлены на постоянной основе (\$3-5/mio), продлен маркетинговый период по инструментам Speedbump еще на 1 год (асимметричная комиссия: \$0 для тейкеров, \$16/mio для мейкеров)

09.09 – электронная платформа EBS eFix Matching будет использовать валютные фиксинги MOEX

28.09 – продление времени торгов TOD с 11:00 до 12:00 мск по CNY, CHF, TRY, KZT, BYN и доработка функционала «SMA пре-трейд проверки»

ДИНАМИКА И СТРУКТУРА ТОРГОВ

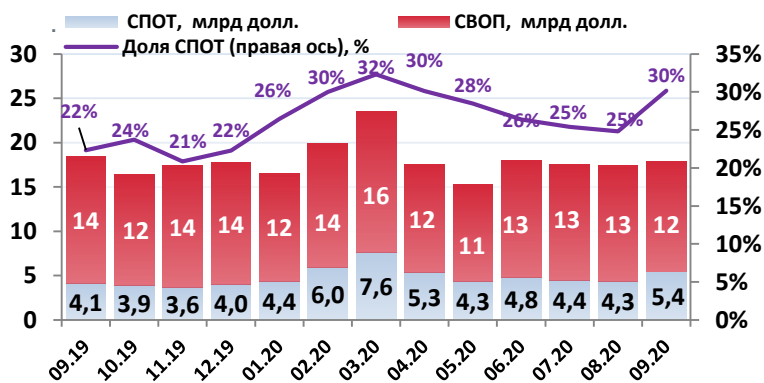
Динамика биржевой доли на межбанковском рынке, %



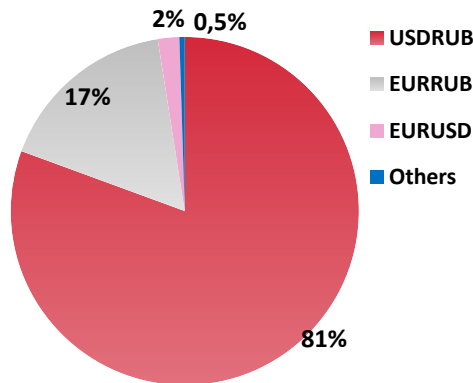
Комментарии

- **Доля МБ в среднем за 2020** на валютном рынке РФ составила **47,5%**.
- По операциям в основных парах доля МБ: **USDRUB – 58,5%**, **EURRUB – 68,5%**, **EURUSD – 8,3%**
- За сен.20 средневзвешенной объем торгов составил – **\$17,9 млрд** (авг.20 – \$17,4 млрд), объем **СПОТ – \$4,4 млрд** (авг.20 – \$4,3 млрд)
- Доля **СПОТ** выросла до уровня **30%** (+5%)
- Распределение по парам валют: доля **USDRUB 81%** (-1%), доля **EURRUB 17%** (+3%), доля **EURUSD 2%** (-1%), прочие **0,5%**

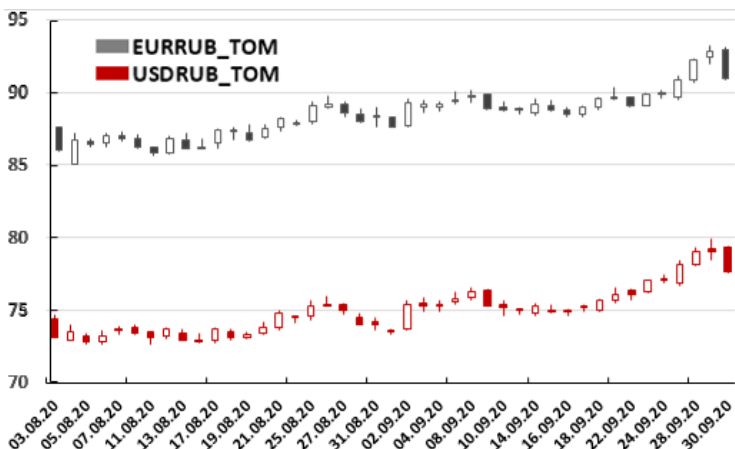
Средневзвешенной объем торгов и доля СПОТ



Распределение объемов по парам валют



Динамика курсов RUB/USD и RUB/EUR

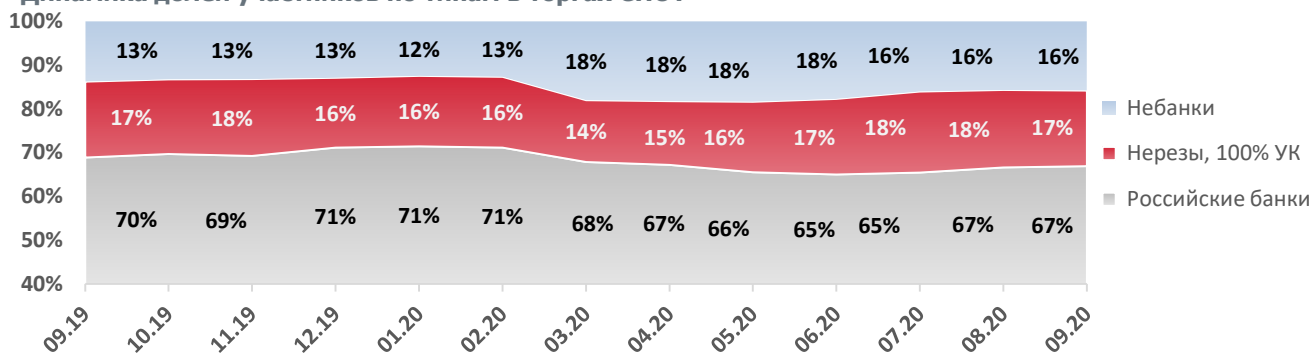


Комментарии

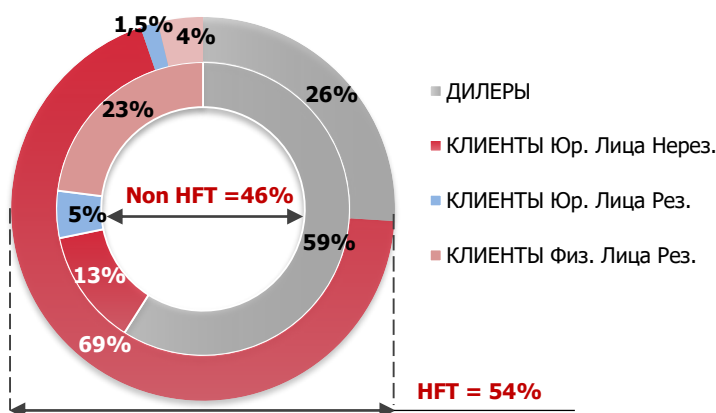
- В сен.20 на фоне снижения цен на нефть и роста волатильности в связи с усилением пандемии курс рубля значительно снизился к основным валютам:
 - средневзвешенный курс **доллара** вырос на 4,26 руб. (+5,8%) до уровня 78,28 Р/\$
 - средневзвешенный курс **евро** вырос на 3,5 руб. (+4,0%) до уровня 91,73 Р/€
- Объемы торгов во внебиржевом режиме **ОТСТ – \$0,7 млрд** (авг.20 – \$0,8 млрд)
- **Рекордные объемы** торгов в режиме Крупные сделки **TDB, TMB – \$2,7 млрд** (авг.20 – \$1,9 млрд)
- **Рекордные объемы GBP/RUB – Р32 млрд** (авг.20 – Р16 млрд)

УЧАСТНИКИ И КЛИЕНТЫ

Динамика долей участников по типам в торгах СПОТ



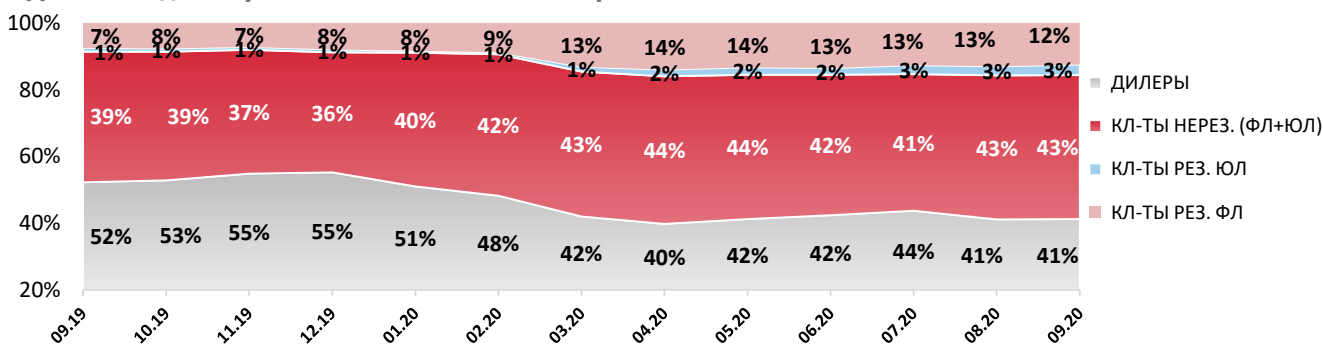
Доли HFT/Не HFT на торгах СПОТ USDRUB, EURRUB



Комментарии

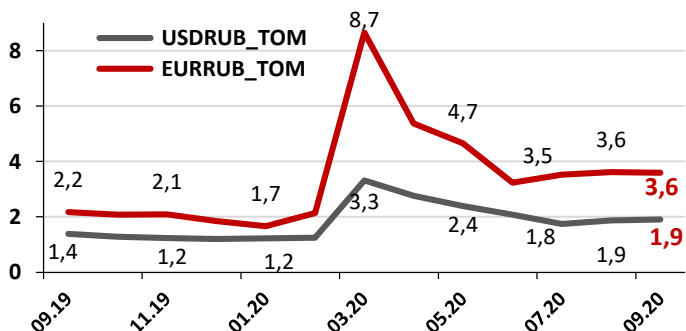
- Доля **клиентов** в обороте **СПОТ** – **58,8%** (-0,1% к авг.20), из них:
 - Нерез-ты** (ЮЛ+ФЛ) – **43,2%** (+0,1%)
 - Физ. лица** (рез-ты) – **12,5%** (-0,5%)
 - Юр. лица** (рез-ты) – **3,0%** (+0,4%)
- Число уникальных зарегистрированных клиентов – **6,2 млн** (+560 тыс. к авг.20)
- Рекордное число** активных клиентов – **462 тыс.** (+58 тыс. к авг.20), из них:
 - Нерезиденты** (ЮЛ+ФЛ) – **1,5 тыс.**
 - Физ. лица** (рез-ты) – **458 тыс.**
 - Юр. лица** (рез-ты) – **1,8 тыс.**
- Доля **HFT** в обороте **СПОТ** – **54%** (+2%)
- Оборот корпораций – \$1,8 млрд (авг.20 – \$1,7 млрд)

Динамика долей участников и клиентов в торгах СПОТ

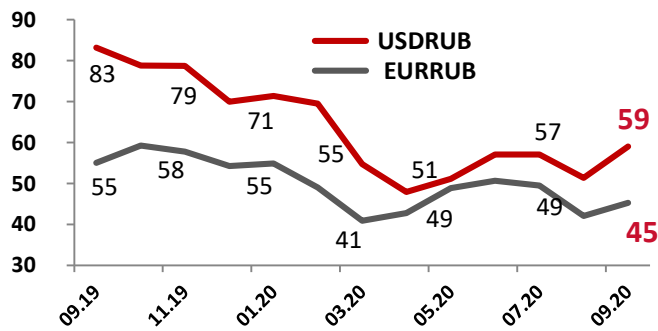


МИКРОСТРУКТУРА РЫНКА

Спред на 1 млн валюты (по квантилю 50%), КОП.



Средний объем сделок СПОТ, ЛОТОВ





КОНТАКТЫ

Титов Сергей

Директор департамента

Денежного рынка

Sergey.Titov@moex.com

+7(495) 363-32-32, доб. 5455

Скабелин Андрей

Директор департамента

Валютного рынка

Andrey.Skabelin@moex.com

+7(495) 363-32-32, доб. 5400

РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ

Настоящий документ был подготовлен и выпущен Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (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 преимущество 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.