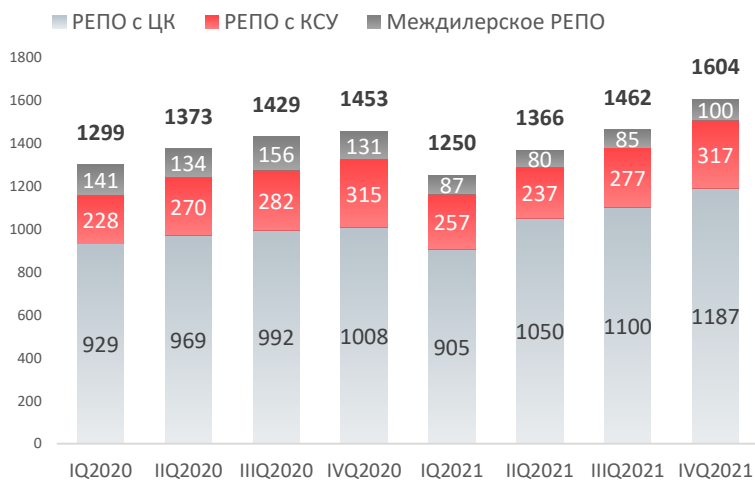
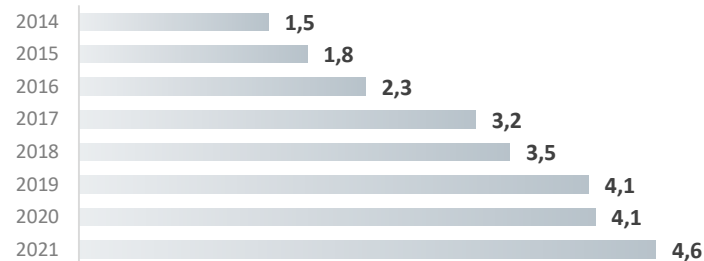


ДИНАМИКА НА ДЕНЕЖНОМ РЫНКЕ

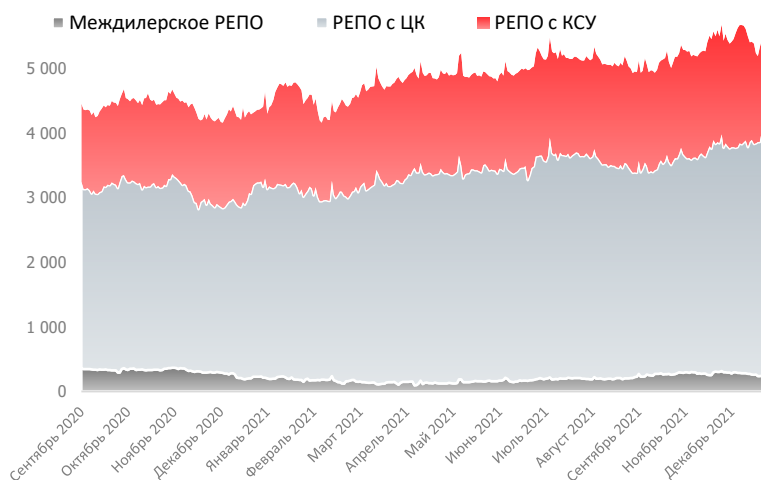
Среднедневной объем торгов, млрд руб.



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

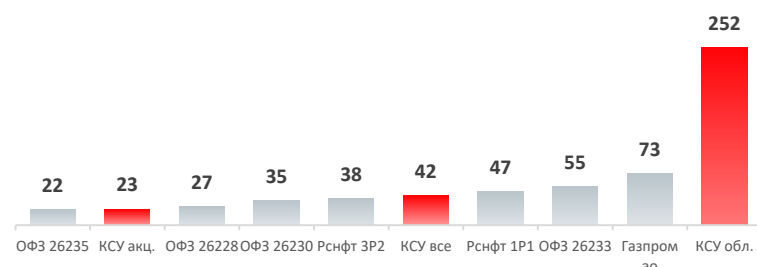


Объем открытой позиции, млрд руб.



Топ-10 ценных бумаг в РЕПО с ЦК

Среднедневной объем торгов 4Q2021, млрд руб.



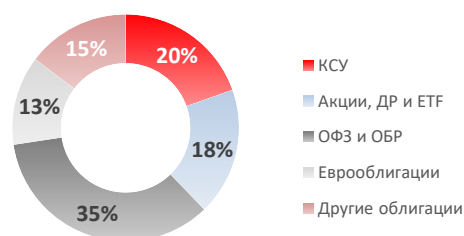
Комментарии

- Среднедневной объем торгов на Денежном рынке (РЕПО и депозитно-кредитные операции) составил – **2,1 трлн руб.**
- Средний срок РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) составил **4,6 дня**
- Среднедневная открытая позиция РЕПО с ЦК составила – **3,4 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция по РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК) составила **1,3 трлн руб.**
- Среднедневная открытая позиция по операциям размещения средств Федерального казначейства через ЦК составила **531 млрд руб.**
- Доля РЕПО с ЦК (вкл. РЕПО с КСУ) в объеме биржевого рынка РЕПО – **84%**
- Доля РЕПО с КСУ (вкл. Депозиты с ЦК) в объеме биржевого рынка РЕПО – **20%**
- Среднедневной объем торгов в сегменте депозитно-кредитных операций составил **232 млрд руб.**

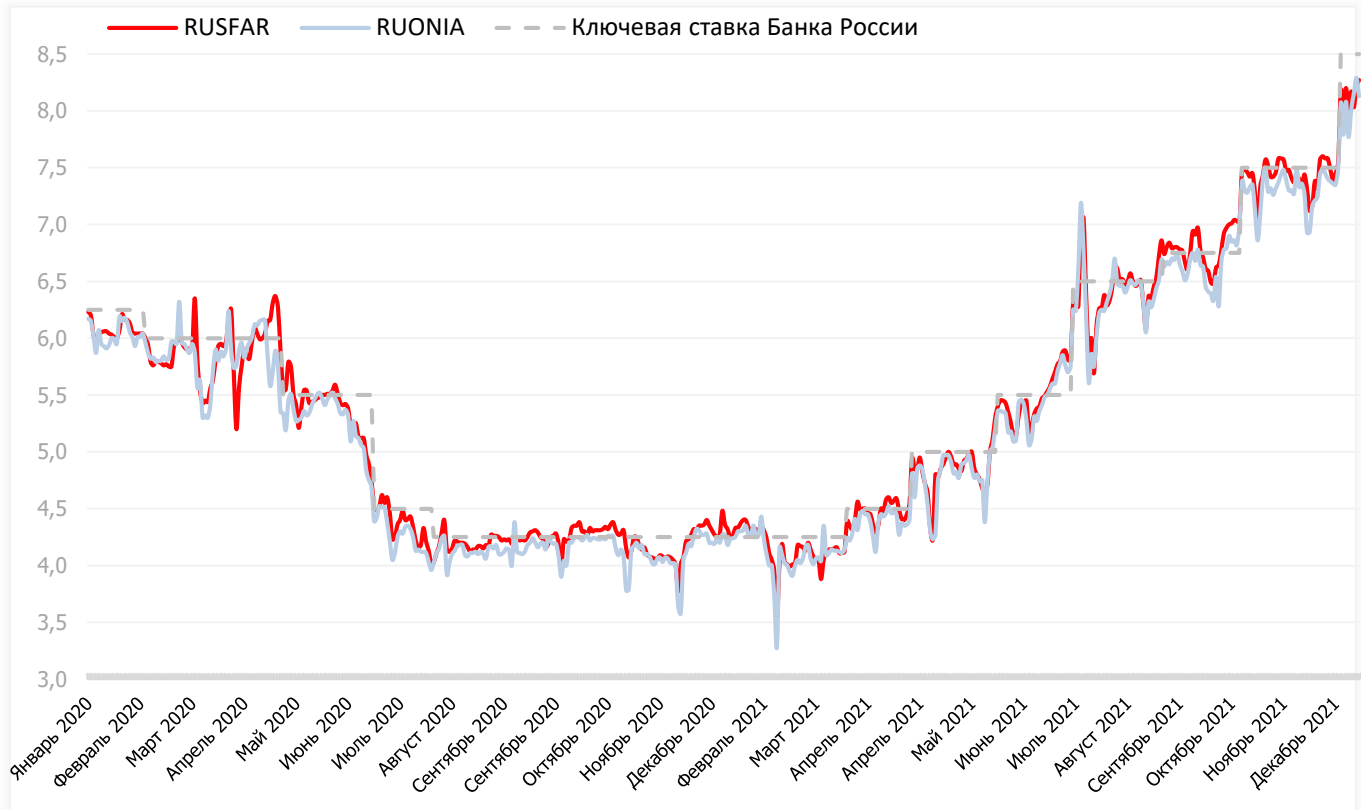
Данные за 4 квартал 2021 г.

Структура рынка РЕПО с ЦК

Объем торгов, 4Q2021, %



ИНДИКАТОРЫ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА



По информации из официального пресс-релиза: Совет директоров Банка России с 20 декабря 2021 года принял решение повысить ключевую ставку на 1,0% до 8,5% годовых.

СОБЫТИЯ ДЕНЕЖНОГО РЫНКА

25 Октября 2021 года:

- реализована возможность расторжения адресных сделок РЕПО с ЦК. Поручение на расторжение сделки можно подать через торговый терминал до исполнения первой части РЕПО.
- предоставлена возможность вносить в пул "КСУ все" драгоценные металлы (золото и серебро), которые сейчас принимаются в пул "КСУ мтл" ("КСУ GC Metal").
- увеличены сроки РЕПО с ИЦБ

6 Декабря 2021 года:

- расширены границы допустимых ставок в РЕПО-М с текущих $\pm 100\%$ до $\pm 999\%$.
- сделки РЕПО без ЦК (РЕПО-М и РЕПО с БР) с ОФЗ с переменным купонным доходом, привязанным к RUONIA, можно заключать сроком до 1 года с неизвестным НКД по 2 части РЕПО (вместо максимального срока около 1 недели ранее).
- даты фиксации списка владельцев по взиманию комиссий за депозитарные расписки подсвечиваются в торговой системе (Таблица финансовые инструменты) и торговом терминале MOEX Trade SE (предупреждения при подаче заявок).

27 Декабря 2021 года:

- Реализованы операции РЕПО с ИЦБ в дни государственных праздников

СОБЫТИЯ

25.10 – Уменьшен размер лота в золоте (инструмент GLDRUB_TOM) до 1 грамма

30.11 – В журнале e-Forex опубликована статья «FX on Exchanges – a story of regional growth, global ambitions and increased trading volumes», с интервью Игоря Марича о FX MOEX

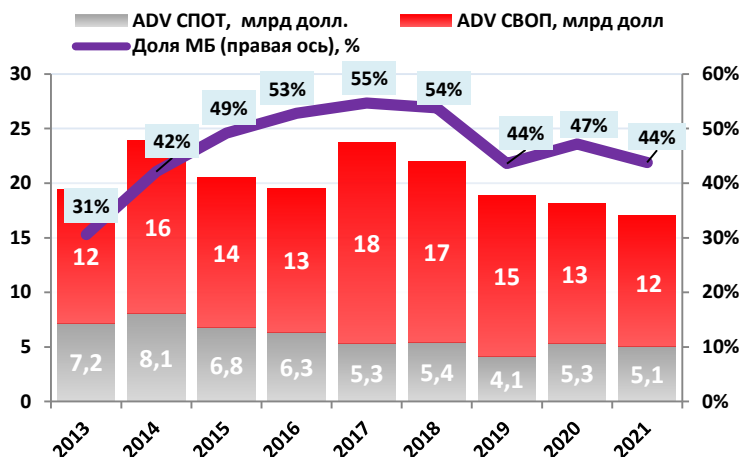
01.12 – Заседание Совместного совета по ВР СРО НФА и ACI Russia. Решения: Ведение реестра организаций, присоединившихся к FX Global Code (реализовано на сайте MOEX); Проведение eFX Summit совместно с ACI World Congress 2022 (Москва, октябрь 2022)

06.12 – Запущены: Аукцион открытия – с 6:50 до 7:00 мск по всем спот-инструментам; Сервис мэтчинга по курсу ЦБ с премией/дисконтом; Сервис по клирингу ОТС сделок с ЦК с пре-трейд проверками лимита в НКЦ

27.12 – ACI Russia наградила MOEX в номинациях «За новые решения по клирингу внебиржевых валютных сделок через центрального контрагента» и «За вклад в развитие фин. грамотности в области управления процентным риском»

ДИНАМИКА И СТРУКТУРА ТОРГОВ

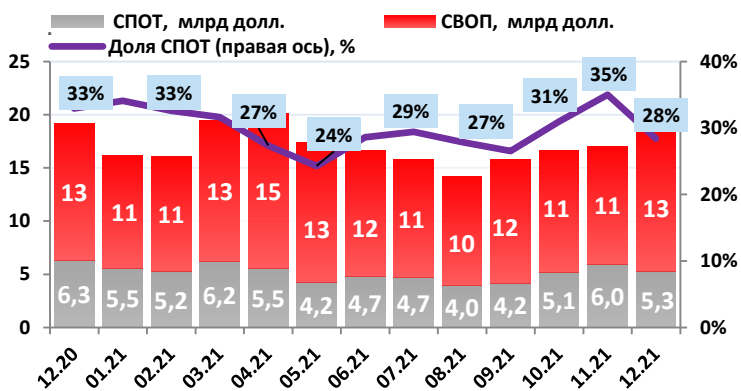
Динамика биржевой доли на межбанковском рынке, %



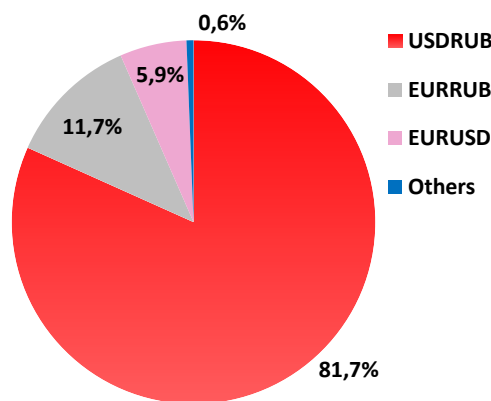
Комментарии

- Доля МБ в среднем за 2021 на валютном рынке РФ составила **43,8%** (-3,3% к 2020)
- По операциям в основных парах доля МБ: **USDRUB – 52,2%**, **EURRUB – 65,8%**, **EURUSD – 12,1%**
- За дек. 21 средненеделной объем торгов составил – **18,5 млрд** (ноя.21 – \$17,0 млрд), объем **СПОТ – \$5,3 млрд** (ноя.21 – \$6,0 млрд)
- Доля **СПОТ** снизилась до уровня **28%** (-7%)
- Распределение по парам валют: доля **USDRUB 81,1%**(+1,1%), доля **EURRUB 11,7%** (-1,0%), доля **EURUSD 5,9%** (-0,1%), прочие **0,7%**

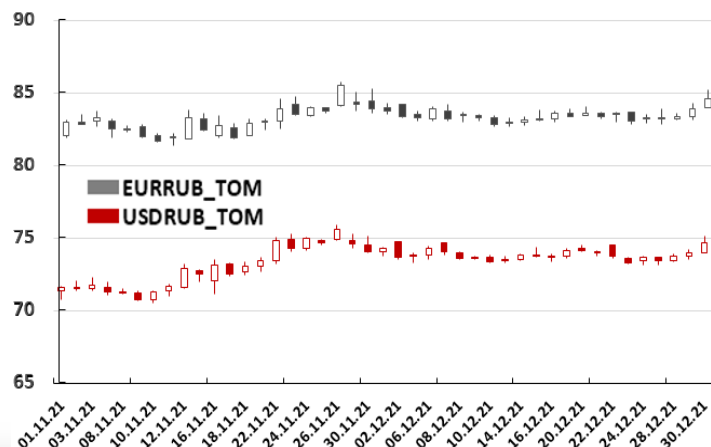
Средненеделной объем торгов и доля СПОТ



Распределение объемов по парам валют



Динамика курсов RUB/USD и RUB/EUR

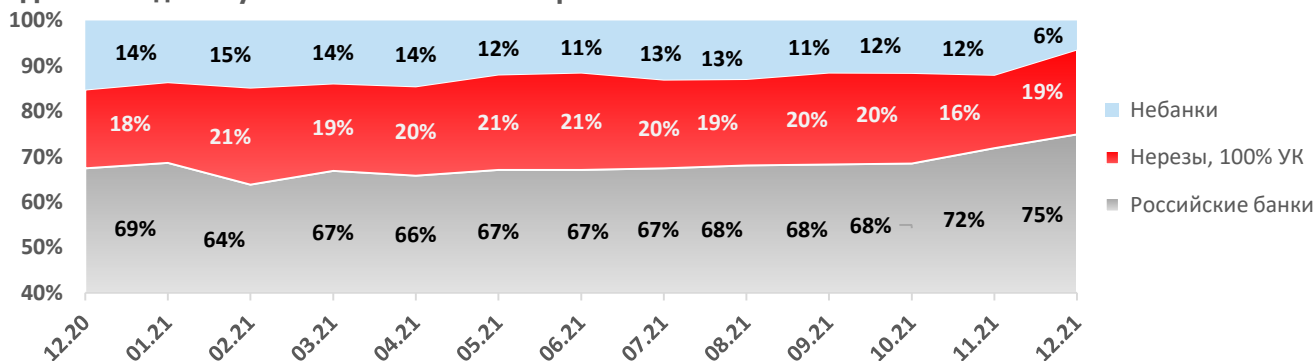


Комментарии

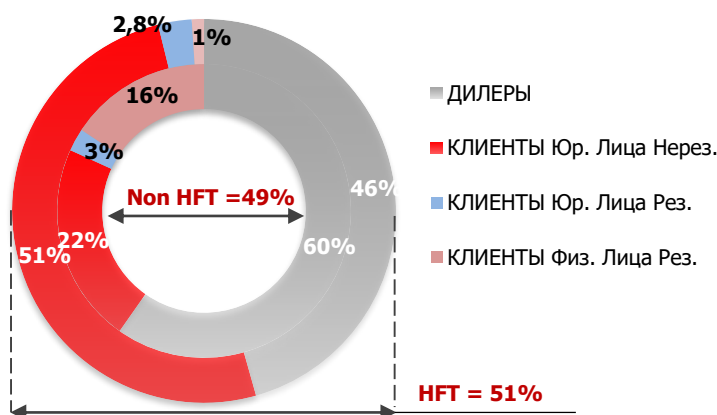
- В дек.21 рост цен на нефть в условиях усиления пандемии и санкционной риторики стабилизировал курс рубля к доллару и евро:
 - средневзвешенный курс **доллара** вырос на 0,08 руб. (+0,1%) до уровня 74,66 Р/\$
 - средневзвешенный курс **евро** снизился на 0,11 руб. (-0,1%) до уровня 84,48 Р/€
- **Объем сделок на ранних торгах (07:00 – 10:00) – \$17 млрд** (ноя.21 – \$15 млрд)
- Объем торгов в **ОТС режимах** (ОТСТ, ОТСФ, RFS, CPCL) – **\$4,3 млрд** (ноя.21 – \$4,4 млрд)
- **Рекордный объем торгов TWAP – \$5,1 млрд**

УЧАСТНИКИ И КЛИЕНТЫ

Динамика долей участников по типам в торгах СПОТ



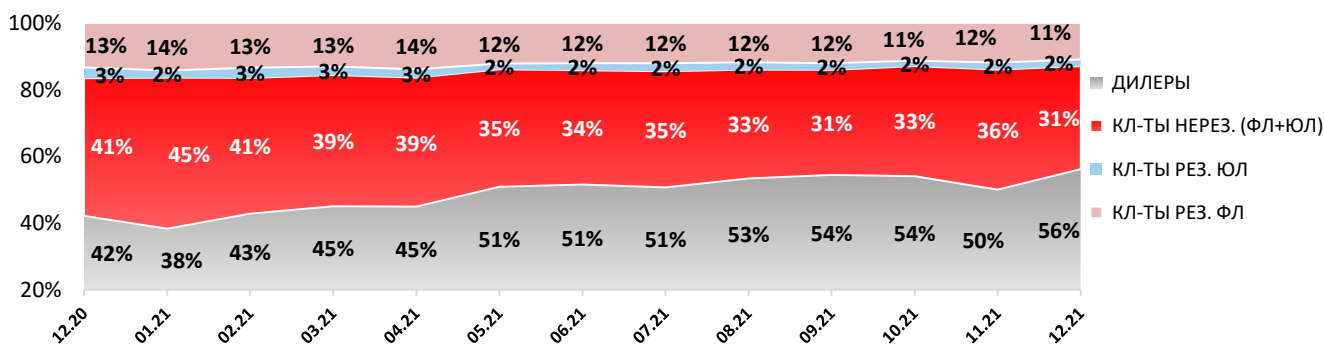
НФТ/Не НФТ на основных торгах СПОТ USDRUB, EURRUB



Комментарии

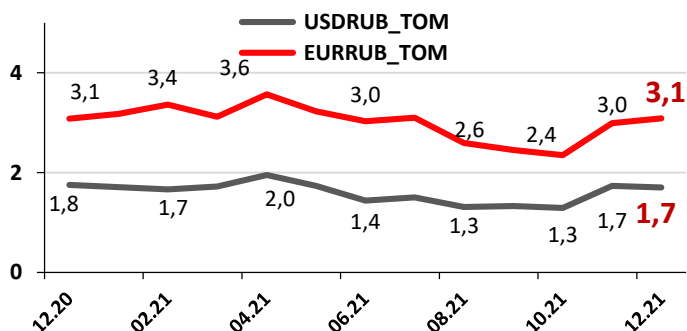
- Доля **клиентов** в обороте **СПОТ** – **43,9%** (-6,3% к ноя. 21), из них:
 - Нерез-ты** (ЮЛ+ФЛ) – **30,8%** (-5,0%)
 - Физ. лица** (рез-ты) – **10,9%** (-1,0%)
 - Юр. лица** (рез-ты) – **2,0%** (-0,1%)
- Число уникальных зарегистрированных клиентов – **16,1 млн** (+600 тыс. к ноя. 21)
- Число активных клиентов **~1 млн** (-87 тыс. к ноя. 21), из них:
 - Нерезиденты** (ЮЛ+ФЛ) – **2,1 тыс.**
 - Физ. лица** (рез-ты) – **997 тыс.**
 - Юр. лица** (рез-ты) – **2,0 тыс.**
- Доля **НФТ** на основных торгах СПОТ - **51%** (-5%)
- Рекордный оборот корпораций** – **\$7,0 млрд** (ноя.21- \$4,9 млрд)

Динамика долей участников и клиентов в торгах СПОТ

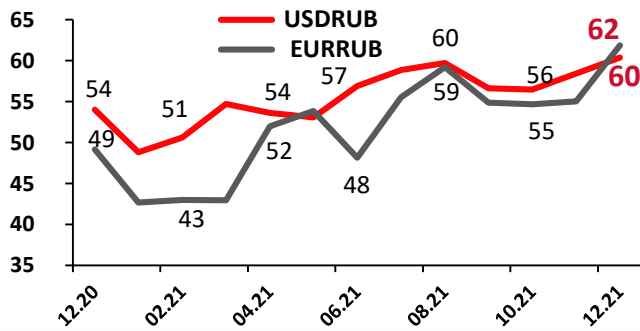


МИКРОСТРУКТУРА РЫНКА

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



Средний объем сделок СПОТ (осн. торги), лот



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-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 презумпциях 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 (b) 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 (b) 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.