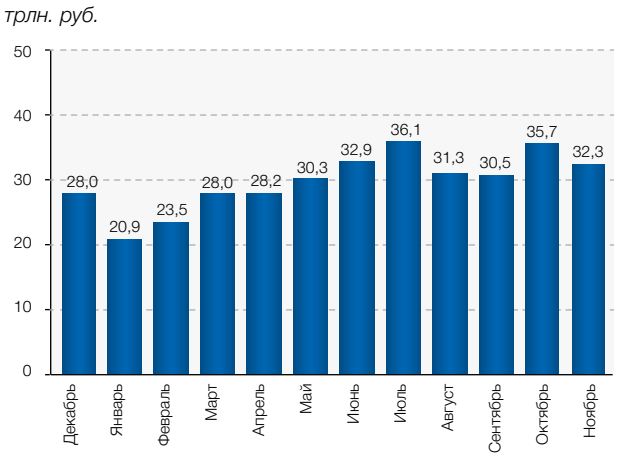
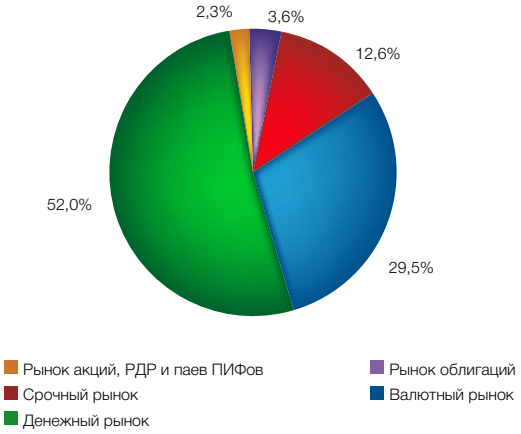
РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ

Ноябрь 2012

Объем торгов на рынках Московской Биржи



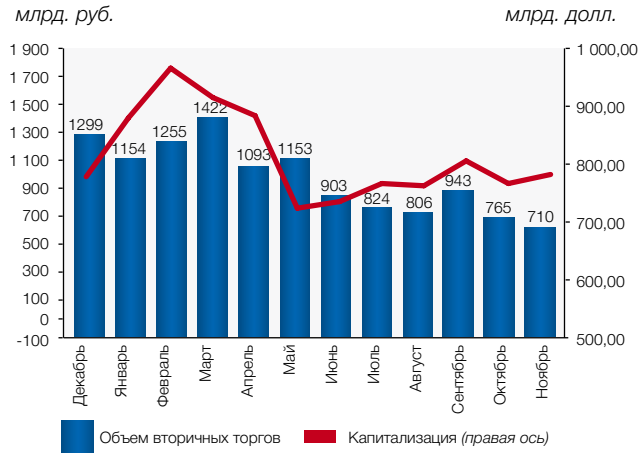
Структура объема торгов на рынках



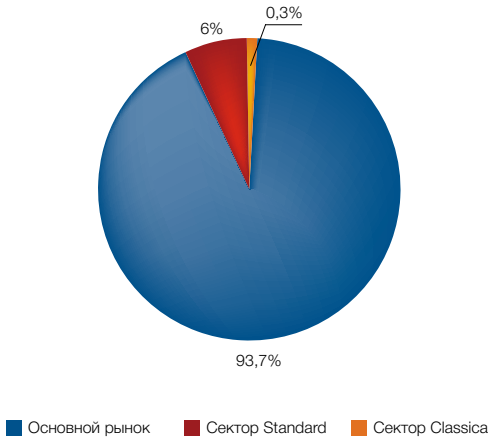
Совокупный объем торгов на рынках Московской Биржи за ноябрь составил 32,3 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 1,53,8 трлн руб., что на 1% ниже показателя предыдущего месяца. На долю рынка акций, РДР и паев ПИФов пришлось 0,7, трлн руб. (2,3% совокупного объема торгов), на долю рынка облигаций — 1,17 трлн руб. (3,6%), на долю срочного рынка — 4,07 трлн руб. (12,6%), на долю валютно-денежного рынка — 26,36 трлн руб. (81,5%), на долю товарного рынка 4 млрд руб.

РЫНОК АКЦИЙ, РДР И ПАЕВ ПИФОВ

Объем вторичных торгов акциями, РДР и паями ПИФов



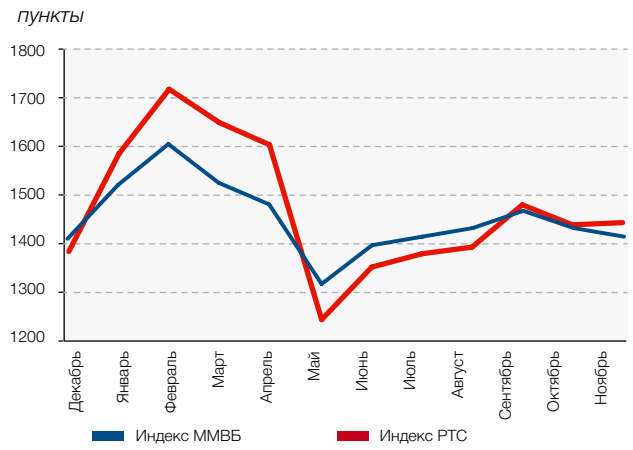
Структура объема торгов за последний месяц



Объем вторичных торгов акциями за ноябрь составил 0,71 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 33,8 млрд руб., что на 2,5 % больше уровня предыдущего месяца. Доля сделок в секторе «Основной рынок» в объеме вторичных торгов акциями, РДР и паями составила 93,7%, на сектор Standard пришлось 6%, на сектор Classica пришлось 0,3%. Объем внебиржевых сделок составил 0,53 трлн руб., что составил 43% от общего объема торгов (вторичные биржевые торги+внебиржевые сделки).

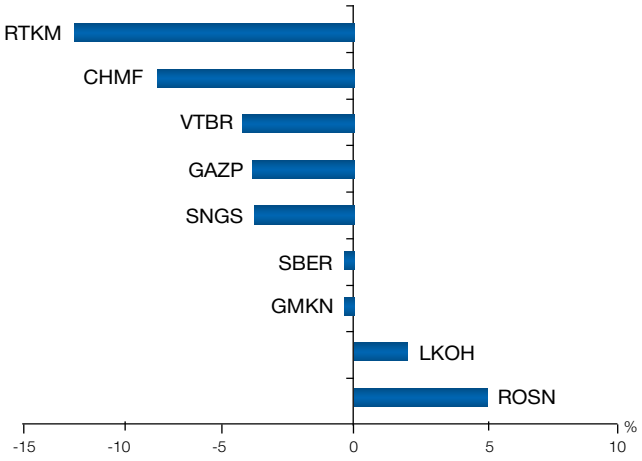
Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

Индексы ММВБ и РТС



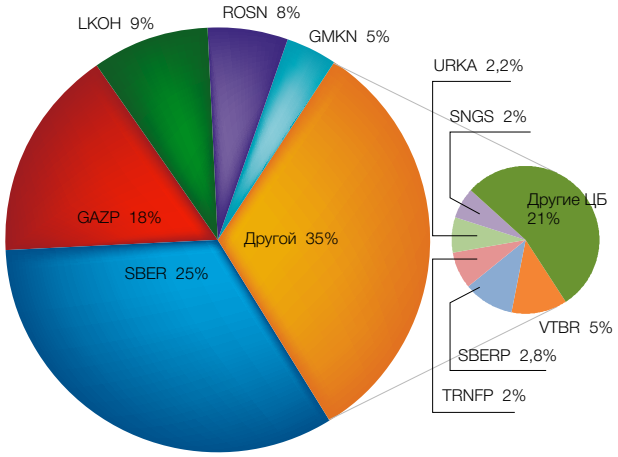
За ноябрь Индекс ММВБ снизился на 1,38% до 1405,97 пунктов (1425,7 на 30 ноября 2012 г.), долларовый Индекс РТС повысился на 0,2% до 1436,55 пунктов (1433,96 на 30 ноября 2012 г.). Капитализация рынка акций за ноябрь повысилась на 1,76% и на последний день месяца составила 775,81 млрд долл. (762,4 млрд долл. на 30 ноября 2012 г.).

Изменение цены закрытия «голубых фишек» за месяц



Среди «голубых фишек» снизились цены обыкновенных акций ОАО «Сургутнефтегаз» — на 4,2% (26,08 руб./акц.), ОАО «Газпром» — на 4,3% (138,67 руб./акц.), ОАО «Северсталь» — на 8,3% (352 руб./акц.), ОАО «Ростелеком» — на 11,8% (108,94 руб./акц.) ОАО «ГМК «Норильский никель» — на 0,4% (4811 руб./акц.), ОАО «Сбербанк России» — на 0,4% (91,41 руб./акц.), ОАО Банк ВТБ — на 4,7% (0,05193 руб./акц.). Выросли цены обыкновенных акций ОАО «ЛУКОЙЛ» — на 1,9% (до 1939,4 руб./акц.), ОАО «НК «Роснефть» — на 4,8% (243,88 руб./акц.)

Лидеры по объему торгов на рынке акций, РДР и паев ПИФов за месяц

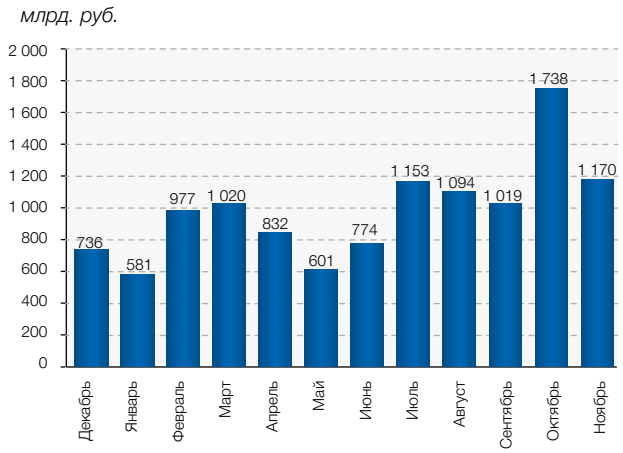


Лидерами по объему торгов стали акции ОАО «Сбербанк России» (SBER), объем торгов которыми за ноябрь составил 180,4 млрд руб. (25%), на втором месте обыкновенные акции ОАО «Газпром» (GAZP) — 124,8 млрд руб. (18%), на третьем месте обыкновенные акции ОАО «ЛУКОЙЛ» (LKOH) — 63,9 млрд руб. (9%), на четвертом месте обыкновенные акции ОАО «Роснефть» (ROSN) — 84,8 млрд руб. (8%), на пятом месте обыкновенные акции ОАО «ГМК «Норильский никель»— 35,3 млрд руб. (5%), на другие ценные бумаги пришлось 246,6 млрд руб. (35%).

Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

РЫНОК КОРПОРАТИВНЫХ, РЕГИОНАЛЬНЫХ, ГОСУДАРСТВЕННЫХ ОБЛИГАЦИЙ И ЕВРООБЛИГАЦИЙ

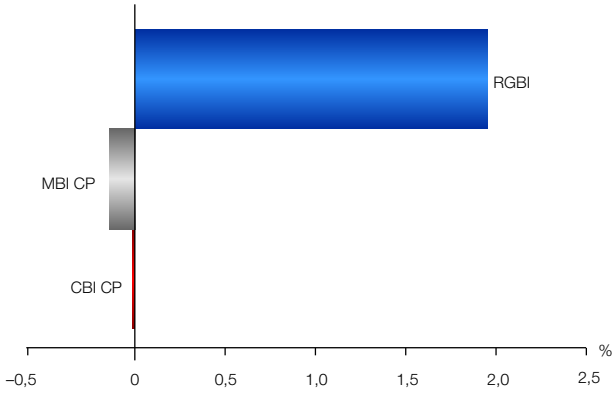
Объем вторичных торгов облигациями



Структура объема торгов за последний месяц

Объем вторичных торгов облигациями за ноябрь составил 1,17 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 55,7 млрд руб., что на 1,6% ниже уровня предыдущего месяца. На долю корпоративных облигаций пришлось 473,13 млрд руб. (40,4% совокупного объема торгов), на долю региональных облигаций — 34,4 млрд руб. (2,9%), на долю государственных облигаций — 506,9 млрд руб. (43,3%). Объем размещений облигаций составил 152,8 млрд руб. (13,1%).

Изменение индексов рынка облигаций за месяц

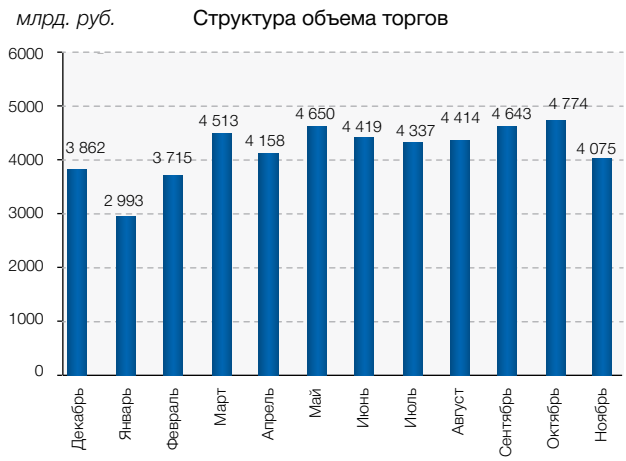


За месяц Индекс корпоративных облигаций MICEX CBI CP (индекс чистых цен) снизился на 0,01% и составил 92,39 пунктов (92,4 п. на 30 ноября 2012 г.), индекс муниципальных облигаций MICEX MBI CP (индекс чистых цен) снизился на 0,16% и составил 96,52 пунктов (96,67 п. на 30 ноября 2012 г.) , индекс государственных облигаций (RGBI) вырос на 1,9% до 136,93 пунктов (134,37 п. на 30 ноября 2012 г.).

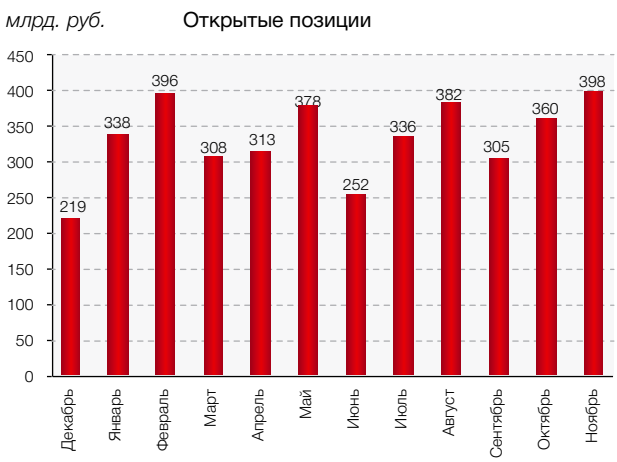
Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

СРОЧНЫЙ РЫНОК

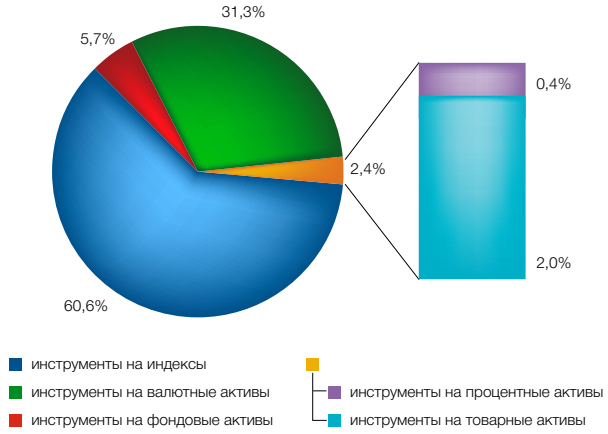
Объем торгов на срочном рынке



Объем открытых позиций на срочном рынке

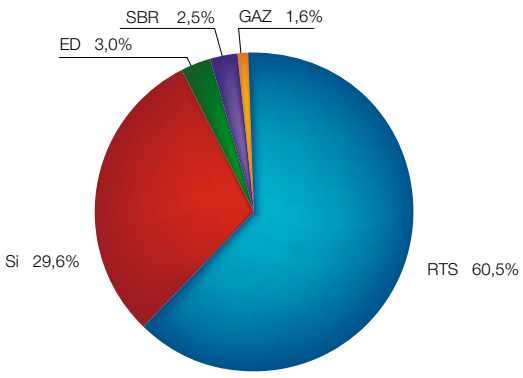


Структура объема торгов за последний месяц



За ноябрь на срочном рынке объем торгов составил 4,07 трлн руб. или 90.6 млн контр. Среднедневной объем торгов составил 194 млрд руб., что на 6,5% ниже уровня предыдущего месяца. Объем открытых позиций на конец месяца составил 11,78 млн контр. или 398 млрд руб.
На долю производных инструментов на индексы пришлось 2,47 трлн руб. (60,6% совокупного объема торгов), инструментов на фондовые активы — 0,2 трлн руб. (5,7%), инструментов на валютные активы — 1,27 трлн руб. (31,3%), инструментов на процентные активы — 13,7 млрд руб. (0,4%), инструментов на товарные активы — 82,7 млрд руб. (2%).

Лидеры по объему торгов на срочном рынке за месяц

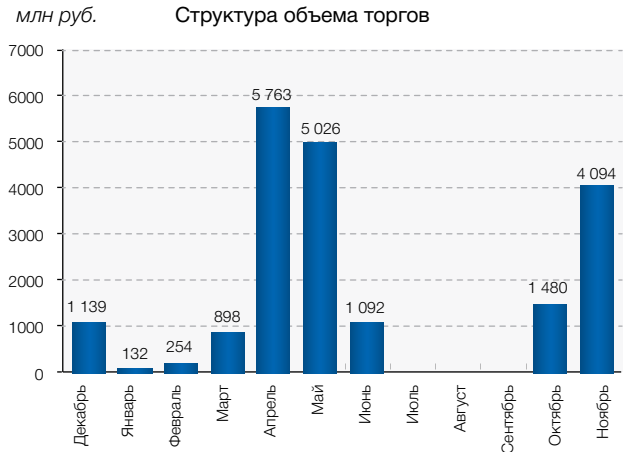


Лидерами по объему торгов на срочном рынке стали Контракт на Индекс РТС (RTS), объем торгов которыми за июль составил 2,46 трлн руб. (60,5%), на втором месте Контракт на курс доллар-рубль (Si-) — 1,15 трлн руб. (28,2%), на третьем месте Контракт на курс евро-доллар (ED-) — 0,115 трлн руб. (2,8%), на четвертом месте Контракт на обыкновенные акции ОАО «Сбербанк России» (SBR) — 0,099 трлн руб. (2,4%), на пятом месте Контракт на акции ОАО «Газпром» (GAZ) — 0,06 трлн руб. (1,5%), на другие производные инструменты пришлось 0,18 трлн руб. (4,6%).

Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

ТОВАРНЫЙ РЫНОК

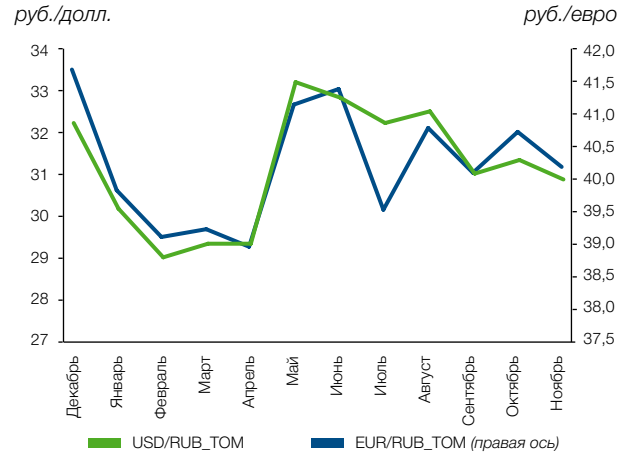
Объем торгов на товарном рынке



Объем торгов на товарном рынке составил 4094 млн руб.

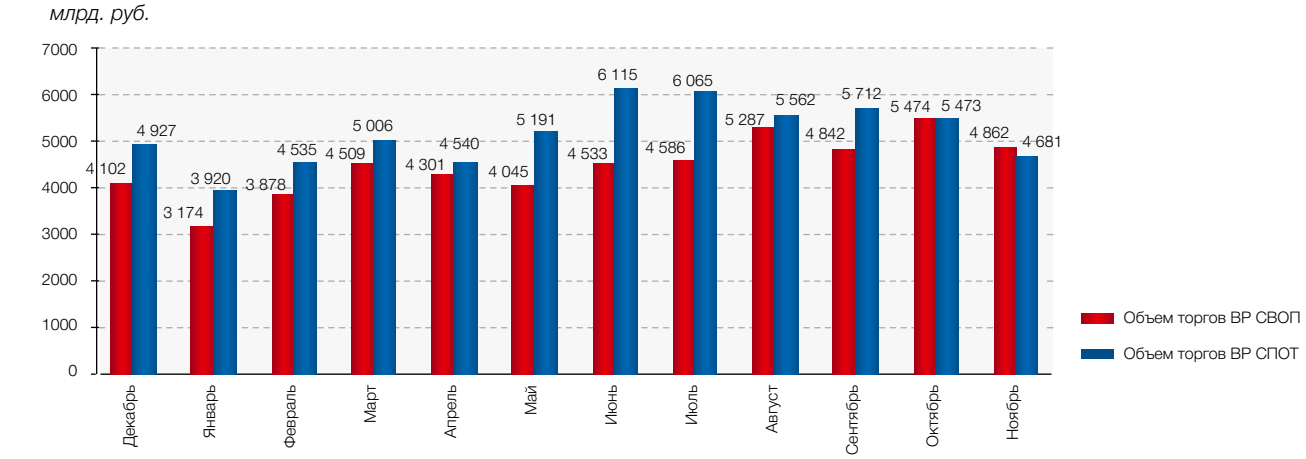
ВАЛЮТНО-ДЕНЕЖНЫЙ РЫНОК

Курсы валют



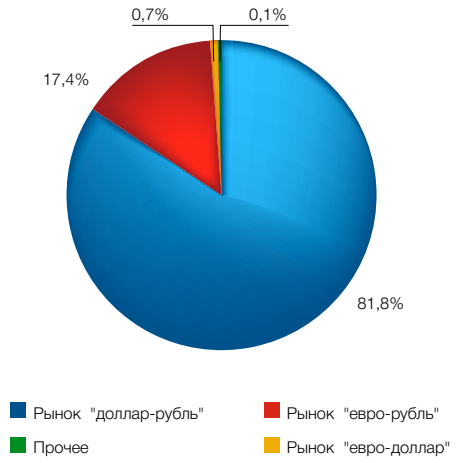
В ноябре наблюдалось ослабление американской и европейской валют. За месяц курс доллара расчетами «завтра» снизился на 0,43 руб. (1,4%) до 30,87 руб./долл., курс евро расчетами «завтра» снизился на 0,53 руб. (1,3%), составив на 30 ноября 2012 г. 40,15 руб./евро.

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.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

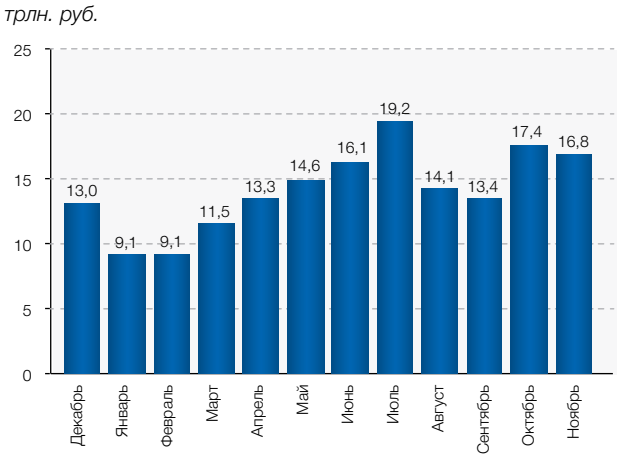
Структура объема торгов за последний месяц



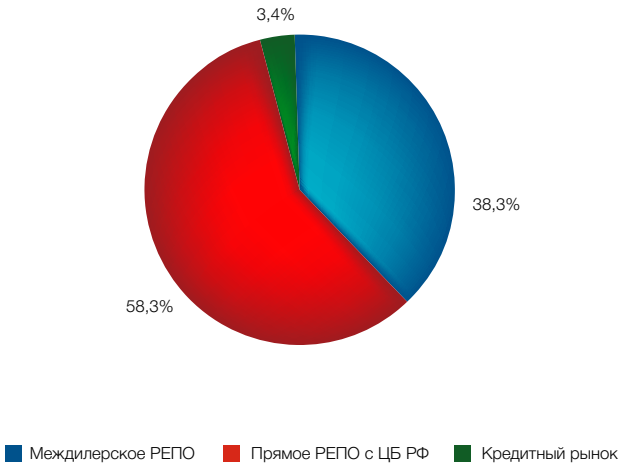
Объем торгов на валютном рынке за ноябрь составил 9,54 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 0,454 трлн руб., что на 4,5% ниже уровня предыдущего месяца. На долю кассовых сделок пришлось 4,68 трлн руб. (49% совокупного объема торгов), на долю операций своп 4,86 трлн руб. (51%).

На долю операций «доллар-рубль» пришлось 7,72 трлн руб. (81,8% совокупного объема торгов), на долю операций «евро-рубль» — 1,64 трлн руб. (17,4%), на долю операций «евро-доллар» — 0,07 трлн руб. (0,7%), на долю операций «юань-рубль» — 0,44 млрд руб. (0,01%), на долю операций «бивалютная корзина» — 9 млрд руб. (0,1%).

Объем торгов на денежном рынке



Структура объема торгов за последний месяц



Объем торгов на денежном рынка за ноябрь составил 16,8 трлн руб. Среднедневной объем торгов составил 0,8 трлн руб., что на 8% выше уровня предыдущего месяца. На долю операций междилерского РЕПО пришлось 6,4 трлн руб. (38,3% совокупного объема торгов), на долю операций прямого РЕПО с ЦБ РФ — 9,8 трлн руб. (58,3%), на долю кредитного рынка — 0,57 трлн руб. (3,4%) (в том числе, депозиты Банка России — 571 млрд руб., ломбардные аукционы Банка России — 1,3 млрд руб, Аукционы ВЭБ — 24,98 млрд руб.

Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА НОЯБРЬ 2012 г.

Наименование	Ноябрь		Октябрь		Изменение объема торгов, %
	объем торгов, млрд руб.	число сделок, тыс. шт.	объем торгов, млрд руб.	число сделок, тыс. шт.	
Вторичный рынок акций, РДР и паев ПИФов					
Основной рынок	659,7	6 473,1	717,7	7 312,9	–8,1
Standard	48,3	206,3	45,6	207,9	5,9
Classica	1,6	0,3	2,0	0,4	–20,0
Итого	709,5	6 679,7	765,3	7 521,2	–7,3
Вторичный рынок облигаций и размещения					
Корпоративные облигации	473,1	30,3	602,0	31,6	–21,4
Региональные облигации	34,4	2,5	31,6	2,7	8,9
Государственные облигации	506,9	6,7	666,3	9,3	–23,9
Еврооблигации	2,8	0,0	1,5	0,0	87,2
Размещения	152,8	0,7	436,5	2,4	–65,0
Итого	1 170,1	40,2	1 737,9	46,0	–32,7
Срочный рынок					
Инструменты на индексы	2 469,2	9 553,6	2 996,2	10 960,7	–17,6
Инструменты на фондовые активы	233,5	2 613,9	236,1	2 543,1	–1,1
Инструменты на валютные активы	1 275,7	2 213,0	1 435,7	2 744,3	–11,1
Инструменты на процентные активы	13,7	0,4	17,7	0,8	–23,0
Инструменты на товарные активы	82,7	132,5	87,8	132,2	–5,8
Итого	4 074,8	14 513,4	4 773,5	16 381,1	–14,6
Валютный рынок					
Доллар-рубль (спот)	4 238,0	393,6	5 021,6	419,8	–15,6
Евро-рубль (спот)	411,6	45,1	411,7	46,5	0,0
Евро-доллар (спот)	22,5	1,5	27,3	1,7	–17,5
Юань-рубль (спот)	0,4	0,2	0,6	0,2	–29,1
Бивалютная корзина (спот)	8,6	0,2	12,6	0,3	–31,4
Доллар-рубль (своп)	3 583,7	11,9	4 274,7	13,6	–16,2
Евро-рубль (своп)	1 231,5	8,2	1 144,1	8,1	7,6
Евро-доллар (своп)	46,7	0,6	54,4	0,6	–14,2
Споты	4 681,2	440,6	5 473,8	468,6	–14,5
Свопы (доллар-рубль, евро-рубль, евро-доллар)	4 862,0	20,7	5 473,2	22,2	–11,2
Итого	9 543,2	461,4	10 947,0	490,8	–12,8
Денежный рынок					
Междилерское РЕПО	6 438,8	132,7	6 986,1	143,6	–7,8
Прямое РЕПО с ЦБ РФ	9 803,5	32,6	9 711,1	31,4	1,0
Кредитный рынок	572,9	1,9	740,0	2,0	–22,6
Итого	16 815,2	167,2	17 437,1	176,9	–3,6
Товарный рынок					
Интервенции	4,1	0,42	1,5	0,16	176,6
Общий объем торгов	**32 316,9**	**21 862,4**	**35 662,3**	**24 616,2**	**–9,4**
Внебиржевые сделки					
Акции, РДР и паи ПИФов	533,8	53,6	674,7	60,4	–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.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009, Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru

РЕЗУЛЬТАТЫ РАБОТЫ РЫНКОВ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ ЗА НОЯБРЬ 2012 г.

Наименование	Значение, пункты		Изменение, %	Изменение с начала года, %
	30 ноя	31 окт		
Индексы акций				
Основные:				
Индекс ММВБ	1 405,97	1 425,70	–1,38	–3,59
Индекс РТС	1 436,55	1 433,96	0,18	–2,65
Капитализационные:				
Высокой капитализации (MICEX Large Cap Index)	2 248,32	2 287,97	–1,73	–3,17
Стандартной капитализации (MICEX Mid Cap Index)	2 297,83	2 301,83	–0,17	–7,19
Базовой капитализации (MICEX Start Cap Index)	3 224,91	3 282,19	–1,75	–4,74
Отраслевые:				
Компаний нефтегазовой отрасли (MICEX O&G)	3 133,21	3 132,25	0,03	–0,36
Компаний энергетической отрасли (MICEX PWR)	1 673,11	1 691,49	–1,09	–9,86
Телекоммуникационных компаний (MICEX TLC)	2 026,19	2 058,40	–1,56	–4,83
Компаний металлургической и горнодобывающей отраслей (MICEX M&M)	2 767,73	2 740,00	1,01	–5,79
Компаний машиностроительной отрасли (MICEX MNF)	1 853,57	1 905,91	–2,75	–4,38
Компаний финансово-банковской отрасли (MICEX FNL)	4 427,65	4 651,97	–4,82	–7,29
Компаний потребительского сектора (MICEX CGS)	4 669,88	4 601,79	1,48	0,36
Компаний химической и нефтехимической отрасли (MICEX CHM)	7 899,74	7 849,99	0,63	–2,30
Тематические:				
Индекс “голубых фишек” ММВБ10	3 251,86	3 290,86	–1,19	–2,96
Индекс “голубых фишек” РТС Стандарт	9 624,04	9 769,90	–1,49	–3,63
Индекс акций “второго эшелона” РТС-2	1 476,62	1 460,79	1,08	–4,90
Индекс ММВБ - инновации	526,28	570,55	–7,76	–13,55
Индекс РТС Сибирь	611,95	628,07	–2,57	–
Индексы облигаций				
Индекс государственных облигаций RGBI (Russian Government Bond Index)	136,93	134,37	1,91	6,05
Индекс корпоративных облигаций MICEX CBI (MICEX Corporate Bond Index)	92,39	92,40	–0,01	0,01
Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI (MICEX Municipal Bond Index)	96,52	96,67	–0,16	–0,19
Индикатор срочного рынка				
Российский индекс волатильности (RTSVX)	22,36	26,83	–16,66	–41,36

Наименование	Значение, руб./единица валюты		Изменение, %	Изменение с начала года, %
	30 ноя	31 окт		
Курсы валют				
Доллар-рубль	30,87	31,31	–1,4	–4,1
Евро-рубль	40,15	40,67	–1,3	–3,5
Юань-рубль	49,56	50,19	–1,2	–2,3
Бивалютная корзина	35,06	35,51	–1,3	–3,8

Представленная Вашему вниманию информация предназначена исключительно для ознакомления.
Настоящий комментарий не содержит никаких рекомендаций и не является прямым руководством к действию на финансовых рынках.
Отдел рыночной статистики Московской Биржи. 125009 Москва, Б. Кисловский пер., 13.
(495) 363-3232, gaints@micex.com, www.rts.micex.ru