



ООО «Cbonds.Ru»
Санкт-Петербург, Пироговская наб., д. 21
Телефон: +7 (812) 336-97-21
<http://www.cbonds-group.com>

Индексы оборотов сегментов финансового рынка

Cbonds публикует индексы оборотов рынка облигаций по различным сегментам российского рынка.

Ежедневно публикуются следующие индексы:

1. Объем ОБР по номиналу, млрд руб.
2. Объем ГКО-ОФЗ по номиналу, млрд руб.
3. Оборот ГКО-ОФЗ по номиналу, млн руб.
4. Оборот ОБР по номиналу, млн руб.
5. Биржевой оборот ГКО-ОФЗ (ММВБ-РТС), млрд руб.
6. Количество сделок ГКО-ОФЗ (ММВБ-РТС)
7. Биржевой оборот ГКО-ОФЗ (ММВБ-РТС.РЕПО), млрд руб.
8. Биржевой оборот МО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ), млрд руб.
9. Биржевой оборот МО (ММВБ-РТС), млрд руб.
10. Биржевой оборот МО (ММВБ-РТС.РПС), млрд руб.
11. Биржевой оборот МО (ММВБ-РТС.РЕПО), млрд руб.
12. Количество сделок МО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ)
13. Биржевой оборот КО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ), млрд руб.
14. Биржевой оборот КО (ММВБ-РТС), млрд руб.
15. Биржевой оборот КО (ММВБ-РТС.РПС), млрд руб.
16. Биржевой оборот КО (ММВБ-РТС.РЕПО), млрд руб.
17. Количество сделок КО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ)

Архив ежедневных индексов по госбумагам (индексы 1-4) ведется с 01.01.2009 года, по муниципальным и корпоративным облигациям (индексы 8-17) – с 01.01.2011 года. Статистика по ежедневным индексам ГКО-ОФЗ (индексы 5-7) ведется с 01.10.2011 года.

Методика расчета индексов

1. Индексы 1-4 – данные ЦБ РФ (показатели по рынкам ГКО-ОФЗ и ОБР (по номиналу)).
2. Индексы 5, 5-7 – данные по биржевому обороту ГКО-ОФЗ по соответствующим торговым площадкам. Индексы рассчитываются как суммарный оборот по данным торговой системы на каждый рабочий день. Индекс 6 рассчитывается как суммарное количество сделок по площадкам ММВБ, ММВБ.Внесистемные в течение торгового дня по ГКО-ОФЗ.
3. Индексы 8-11 – данные по биржевому обороту муниципальных облигаций по соответствующим торговым площадкам. Индексы рассчитываются как суммарный оборот по данным торговых систем ММВБ и СПВБ на каждый рабочий день.
4. Индексы 13-16 – данные по биржевому обороту корпоративных облигаций по соответствующим торговым площадкам. Индексы рассчитываются как суммарный оборот по данным торговых систем ММВБ и СПВБ на каждый рабочий день.

5. Индексы 12 и 17 рассчитываются как суммарное количество сделок по площадкам ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ в течение торгового дня по сегментам муниципальных и корпоративных облигаций.
6. Если валюта выпуска облигаций отлична от RUB, то объем торгов по выпуску переводится в рубли по курсу ЦБ РФ на дату расчета индекса.

Ежемесячно публикуются следующие индексы:

1. Оборот ГКО-ОФЗ по номиналу, млрд руб.
2. Оборот ОБР по номиналу, млрд руб.
3. Биржевой оборот КО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС. РПС, СПВБ), млрд руб.
4. Количество сделок КО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС. РПС, СПВБ)
5. Внебиржевой оборот КО (НРД), млрд руб.
6. Количество сделок КО (НРД)
7. Биржевой оборот МО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ), млрд руб.
8. Количество сделок МО (ММВБ-РТС, ММВБ-РТС.РПС, СПВБ)
9. Внебиржевой оборот МО (НРД), млрд руб.
10. Количество сделок МО (НРД)

Архив индексов ведется с 01.01.2002 года.

Методика расчета индексов

1. Индексы 1-4, 7-8 рассчитываются по данным соответствующих ежедневных индексов за месяц.
2. Индексы 5-6, 9-10 рассчитываются по итогам месяца по муниципальным и корпоративным облигациям на основе еженедельных данных НРД (данные по суммарному обороту и количеству сделок за текущую неделю загружаются по пятницам).

Контактные лица:

Скурихина Елена Аркадьевна, Специалист отдела Cbonds.
тел/факс: (812) 336 9721, доб.118. e-mail: sea@cbonds.info