

Валютный рынок России

“До” и “После”

(v1.4 2022-04-08)

ВАЛЮТНЫЙ РЫНОК Российской Федерации

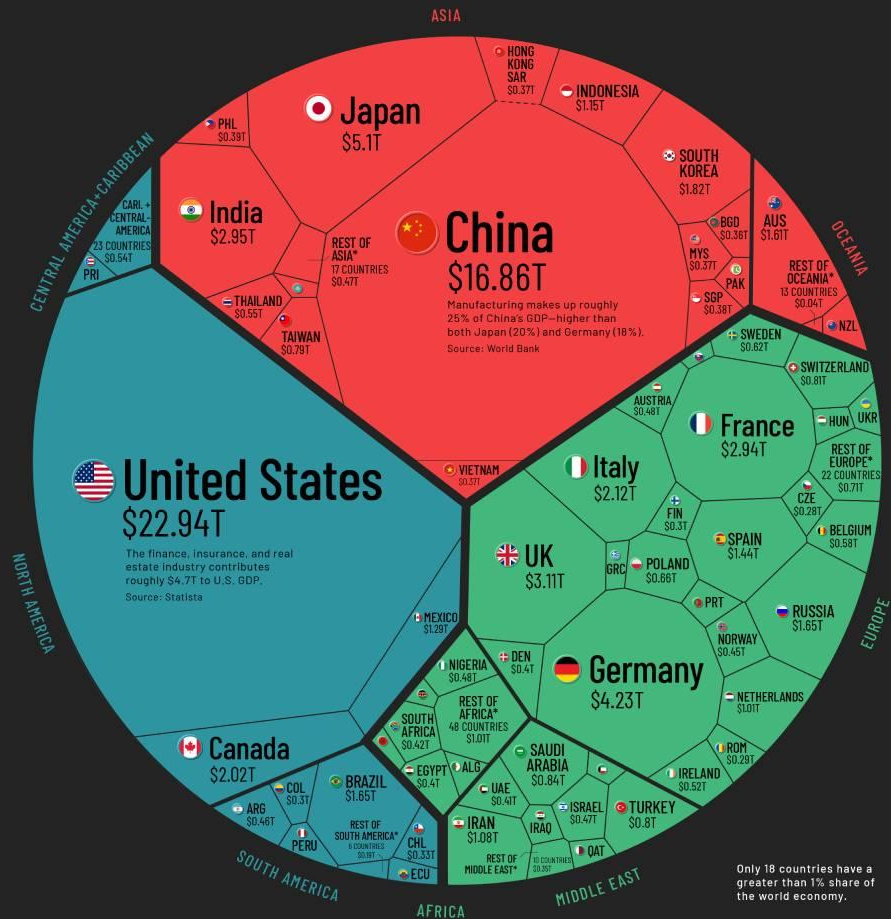
“До” и “После”

April 2022



Gross domestic product (GDP) serves as a barometer for a country's economic health. It measures the total market value of final goods and services produced in a country during a given year.

Together, the U.S. and China account for 42% of global GDP. Here is GDP by country according to IMF estimates.

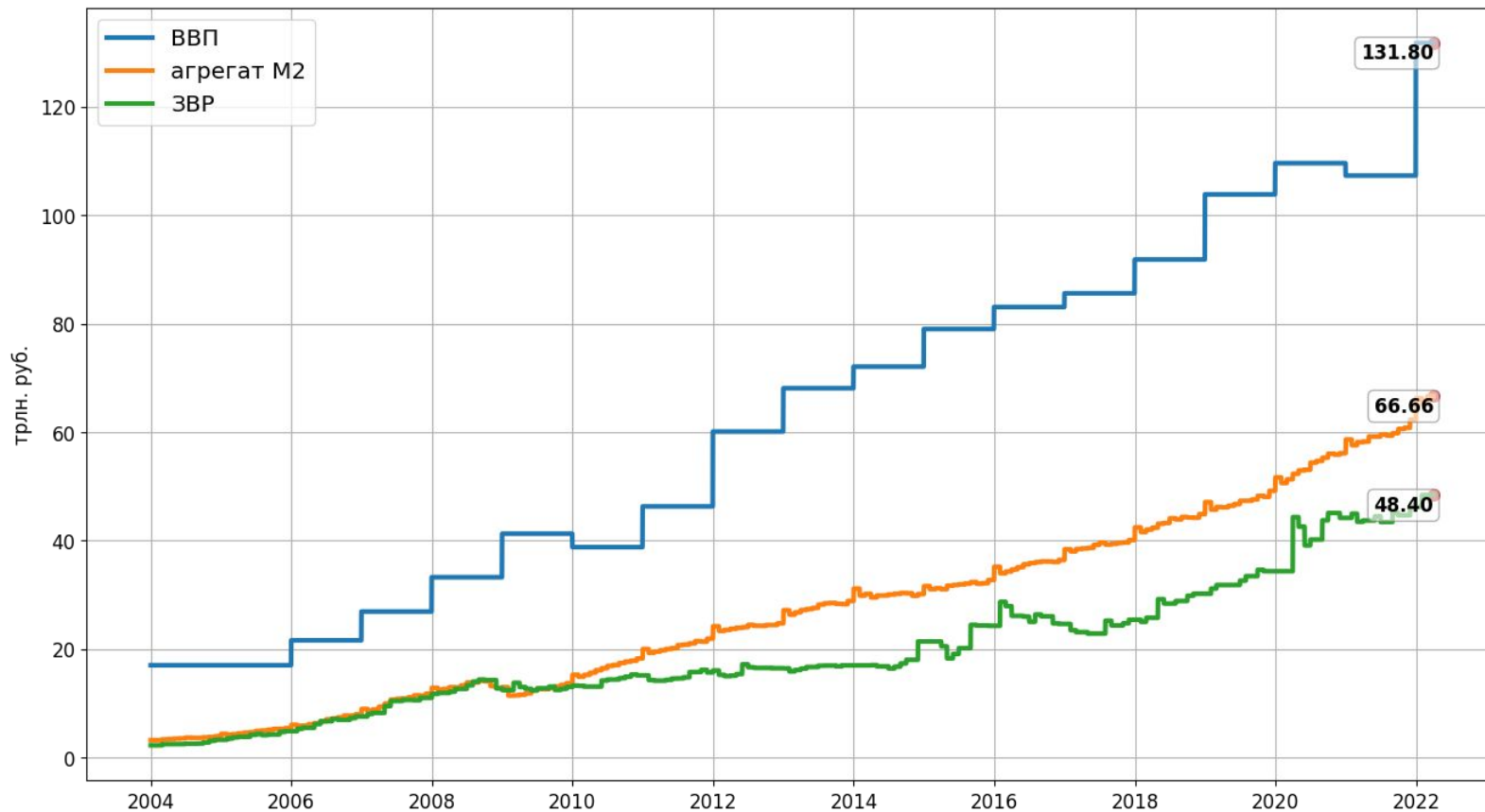


Only 18 countries have a greater than 1% share of the world economy.

РАВНОВЕСНЫЙ КУРС РУБЛЯ

ВВП России + агрегат М2

Динамика роста ВВП, ЗВР и агрегата М2 (трлн. RUB)



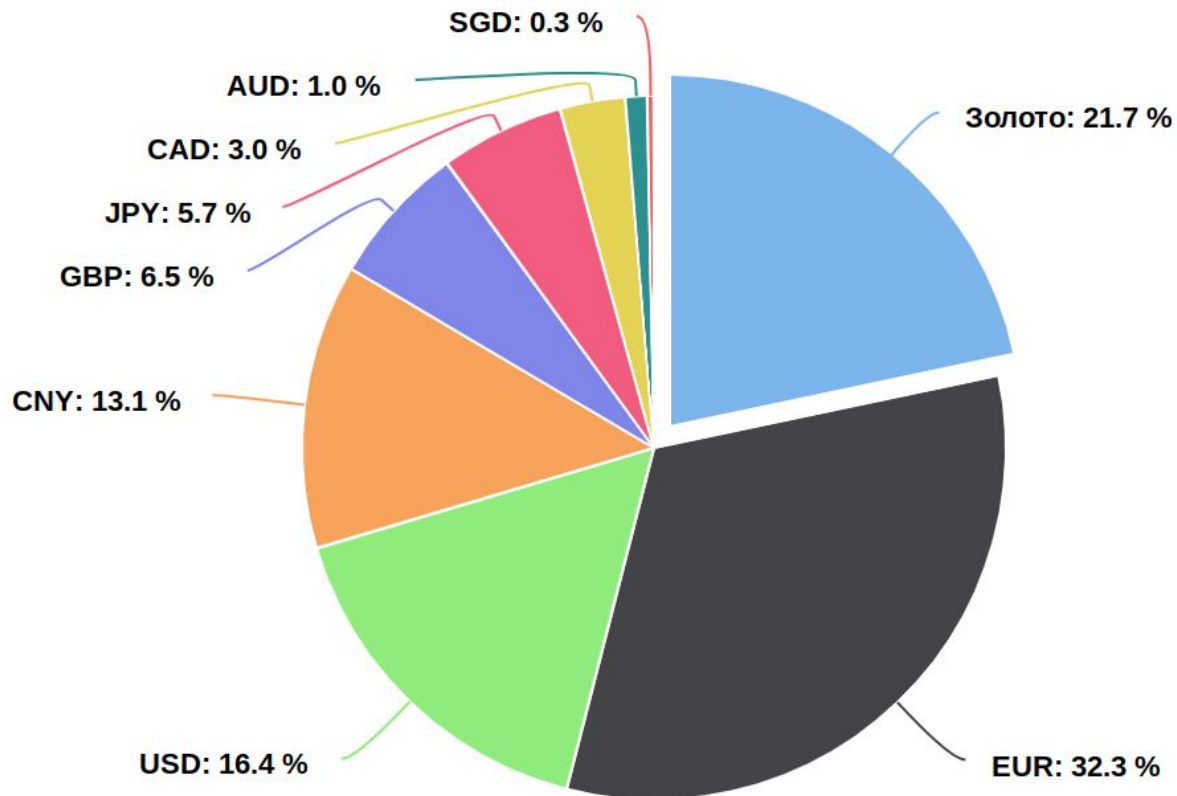
ЗОЛОТОВАЛЮТНЫЕ РЕЗЕРВЫ (ЗВР)

Международные резервы ЦБ РФ (млрд. USD)

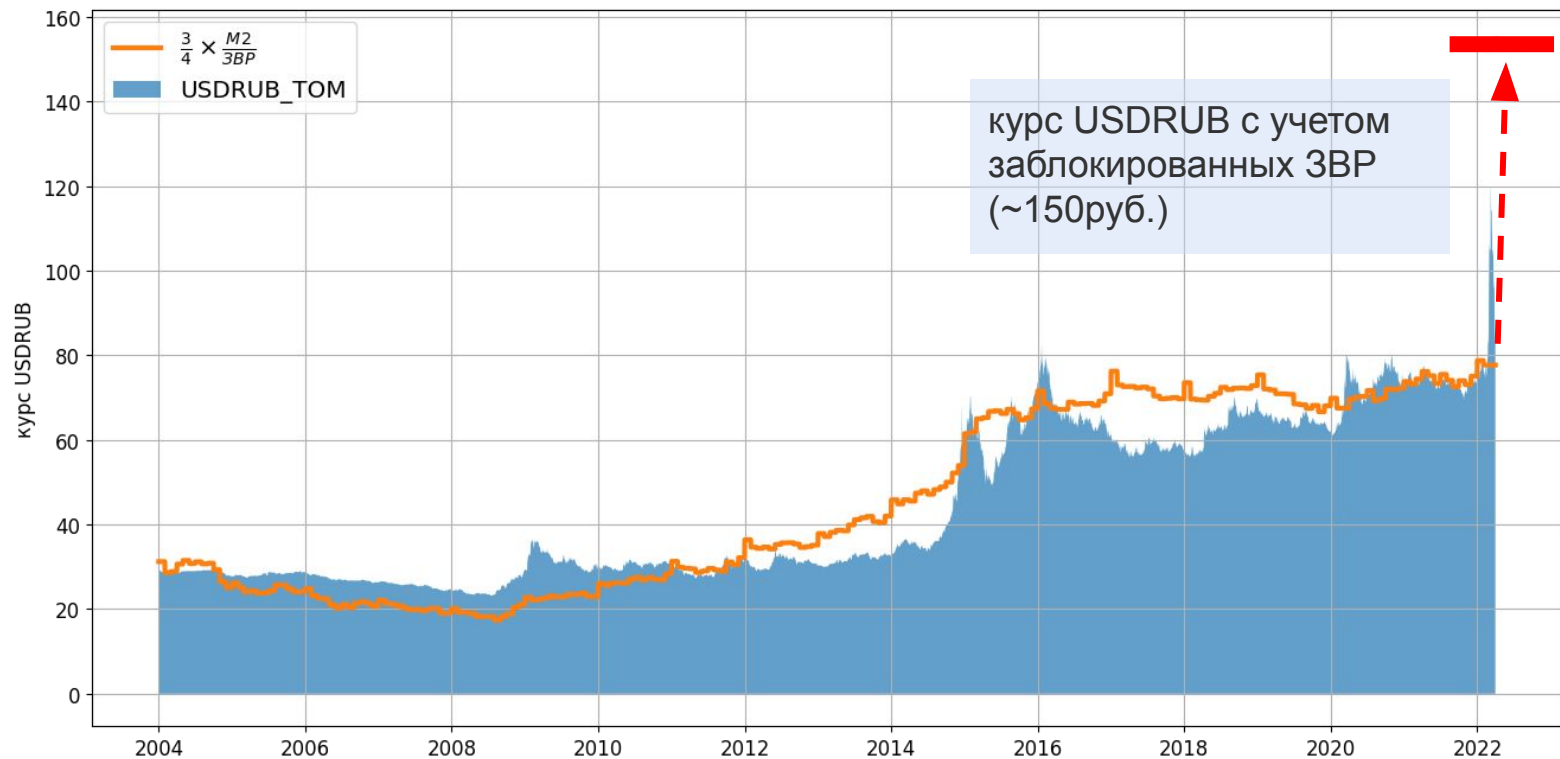


Международные резервы ЦБ РФ

585,3 млрд. долларов США на 30.06.2021



РАВНОВЕСНЫЙ КУРС РУБЛЯ



$$\text{USDRUB} \approx 0.75 * M2 / \text{ЗБР}$$

где M2 - денежный агрегат M2 (млрд. руб.)

ЗБР - золотовалютные резервы (\$ млрд.)

КОТИРОВКИ

(СТАВКА ЦБ, ОФЗ, iMOEX, RTSi)

КОТИРОВКИ: ОФЗ-3У и СТАВКА ЦБ (2004-2021)



КОТИРОВКИ: ОФЗ-3У и RUSFAR (1У)

RUSFAR ON RUB

Последняя ставка: 08.04.2022 12:30:02



КОТИРОВКИ: ИНДЕКС МОС. БИРЖИ (iMOEX)



КОТИРОВКИ: ИНДЕКС RTS (RTSI)



КОТИРОВКИ: Доллар США (USDRUB)



КОТИРОВКИ: Евро (EURRUB)



КОТИРОВКИ: Китайский юань (CNYRUB)



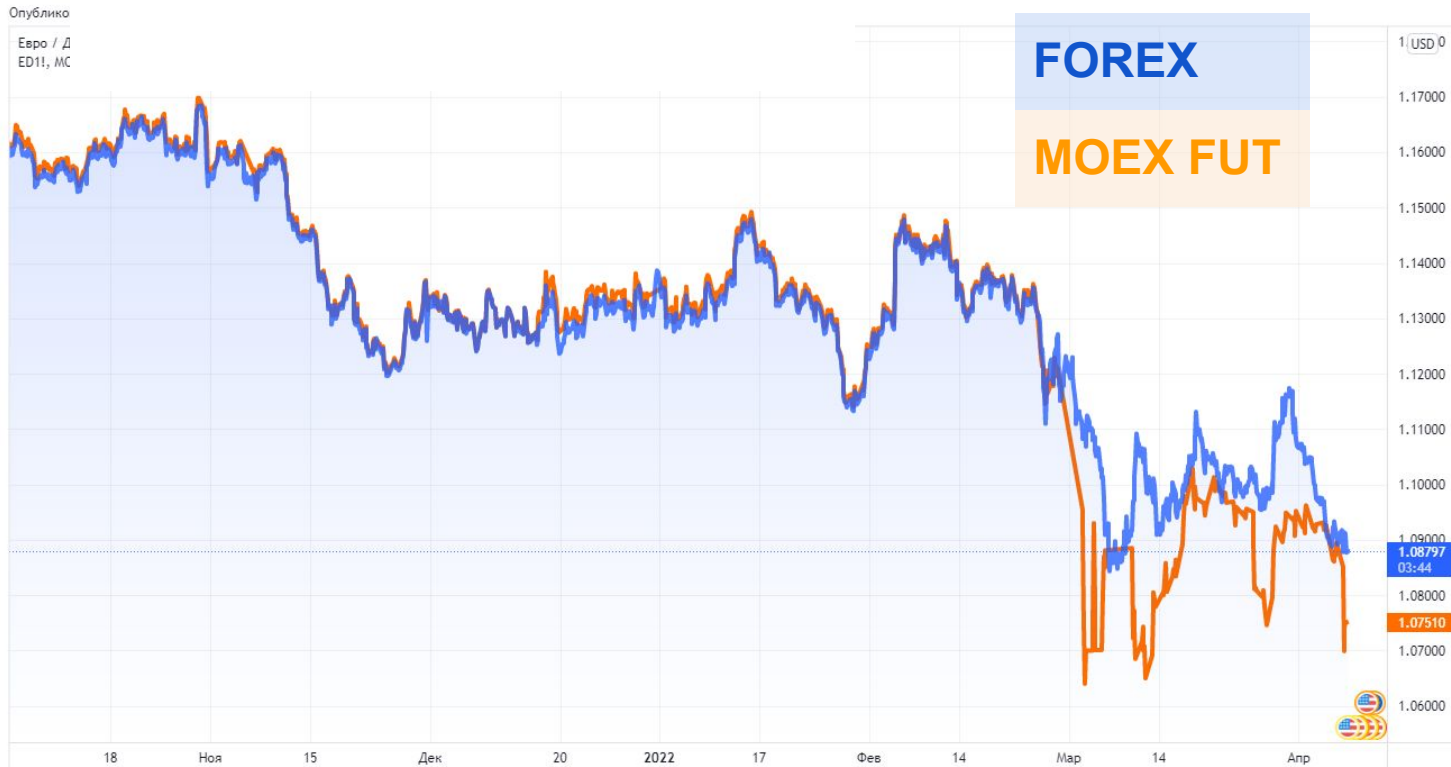
КОТИРОВКИ: ОБЪЕМЫ ВАЛЮТНОГО РЫНКА

Инструмент	До (\$ млрд./нед.)	После (\$ млрд./нед.)	Изменение объемов
USDRUB_TOM	16,67	5,79	-65%
СВОП USD_TODTOM	38,89	21,05	-46%
ФЬЮЧЕРС НА USDRUB	25,00	5,00	-80%
EURRUB_TOM	2,08	2,28	10%
CNYRUB_TOM	0,08	0,53	532%

средний курс доллара "До"	75
средний курс доллара "После"	95

АНОМАЛИИ ВАЛЮТНОГО РЫНКА

АНОМАЛИИ: EURUSD FOREX vs MOEX FUT



EDM2 [МБ СР: Фьючерсы] ...

Покупка	Цена	Продажа
35	1,0642	
1	1,0643	
1	1,0644	
23	1,0645	
1	1,0647	
5	1,0648	
3	1,0649	
45	1,0650	
7	1,0651	
1	1,0652	
31	1,0653	
1	1,0654	
52	1,0655	
31	1,0656	
6	1,0657	
2	1,0658	
5	1,0659	
8	1,0660	
9	1,0661	
2	1,0662	
1	1,0663	
	1,0670	3
	1,0671	1
	1,0672	2
	1,0673	1
	1,0674	6
	1,0675	1
	1,0677	3
	1,0678	7
	1,0679	15
	1,0680	2
	1,0683	6
	1,0684	24
	1,0685	31
	1,0686	71
	1,0687	3
	1,0688	125
	1,0689	179
	1,0690	189
	1,0691	10
	1,0692	9

МОEX ED-6.22
НЕТ
ЛИКВИДНОСТИ

АНОМАЛИИ: ОТРИЦАТЕЛЬНЫЙ СВОП USD

USD_TODTOM



АНОМАЛИИ: ОТРИЦАТЕЛЬНЫЙ СВОП EUR

EUR_TODTOM

