

Обзор по объемам рынка FX северной Америки

КОМИТЕТ ПО ВАЛЮТНОМУ РЫНКУ
ПОЛУГОДИЧНЫЙ ОТЧЕТ ПО ОБЪЕМАМ РЫНКА ФОРЕКС
АПРЕЛЬ 2007

Все данные в миллионах долларов США

Средний дневной оборот

Инструмент	Текущая сумма	Изменение в долларах к прошлому году	Изменение к прошлому году в процентах
Сделки СПОТ	273 961	-2 090	-0,8
Сделки ФОРВАРД	101 079	5 455	5,4
Сделки FX СВОП	189 347	31 837	16,8
Опционы	53 801	5 707	10,6
Итого	618 188	40 909	6,6

Объем за месяц

Инструмент	Текущая сумма	Изменение в долларах к прошлому году	Изменение к прошлому году в процентах
Сделки СПОТ	5 753 117	232 101	4,0
Сделки ФОРВАРД	2 122 667	210 187	9,9
Сделки FX СВОП	3 976 256	826 059	20,8
Опционы	1 129 875	167 993	14,9
Итого	12 981 915	1 436 340	11,1

20 торговых дней в апреле 2006 и 21 день в апреле 2007

2а. СДЕЛКИ СПОТ, средний дневной объем
миллионов долларов США

	Контрагент				
Валютная пара	Подотчетные Дилеры	Другие Дилеры	Другие финансовые Участники	Нефинансовые Участники	Всего
Доллар США против					
Евро	14 057	42 494	22 689	5 582	84 822
Японская йена	7 030	18 022	11 366	2 648	39 066
Фунт стерлингов	5 529	15 763	10 313	2 005	33 610
Канадский доллар	3 391	6 536	3 592	1 852	15 371
Французский франк	2 598	7 352	4 780	843	15 573
Австралийский доллар	1 986	5 268	3 230	604	11 088
Аргентинский песо	38	37	58	10	143
Бразильский реал	268	505	535	154	1 462
Чилийский песо	178	161	241	43	623
Мексиканский песо	1 804	4 184	1 531	1 043	8 562
Другие валюты	2 293	5 113	6 395	2 425	16 226
Евро против					
Японской йены	1 932	8 115	4 366	521	14 934
Фунт стерлингов	1 270	3 910	1 622	747	7 549
Французский франк	1 299	4 100	2 238	454	8 091
Другие валютные пары	2 125	5 144	5 008	4 564	16 841
Всего	45 798	126 704	77 964	23 495	273 961

2b.Форварды OUTRIGHT, Средний объем за день
Миллионов долларов США

	Контрагент				
	Подотчетные	Другие	Другие	Нефинансовые	
Валютная пара	Дилеры	Дилеры	финансовые Участники	Участники	Всего
Доллар США против					
Евро	1 639	4 451	15 491	5 069	26 650
Японская йена	752	3 421	7 463	2 240	13 876
Фунт стерлингов	787	2 268	5 331	1 909	10 295
Канадский доллар	335	1 094	2 996	1 846	6 271
Французский франк	313	809	1 915	803	3 840
Австралийский доллар	456	1 289	3 001	657	5 403
Аргентинский песо	64	104	65	24	257
Бразильский реал	850	1 935	1 825	369	4 979
Чилийский песо	199	473	131	40	843
Мексиканский песо	306	896	724	845	2 771
Другие валюты	1 562	3 734	6 371	2 479	14 146
Евро против					
Японской йены	214	538	788	478	2 018
Фунт стерлингов	55	203	350	677	1 285
Французский франк	63	189	314	370	936
Другие валютные пары	437	1 391	2 883	2 798	7 509
Всего	8 032	22 795	49 648	20 604	101 079

2с. FX СВОП, Средний объем за день

Миллионов долларов США

Валютная пара	Контрагент				Всего
	Подотчетные Дилеры	Другие Дилеры	Другие финансовые Участники	Нефинансовые Участники	
Доллар США против					
Евро	7 215	26 163	14 330	3 187	50 895
Японская йена	5 977	17 111	7 349	1 433	31 870
Фунт стерлингов	3 520	14 669	7 752	1 152	27 093
Канадский доллар	5 765	11 973	5 087	1 760	24 585
Французский франк	2 044	6 707	2 690	286	11 727
Австралийский доллар	1 523	7 700	2 773	281	12 277
Аргентинский песо	5	8	4	1	18
Бразильский реал	51	101	118	14	284
Чилийский песо	29	49	4	0	82
Мексиканский песо	2 141	4 815	1 672	303	8 931
Другие валюты	2 840	8 531	4 047	635	16 053
Евро против					
Японской йены	62	128	274	92	556
Фунт стерлингов	60	66	549	442	1 117
Французский франк	28	46	55	97	226
Другие валютные пары	392	750	2 096	395	3 633
Всего	31 652	98 817	48 800	10 078	189 347

2е. Средний объем за день, по методу заключения сделки и валютной паре
Миллионов долларов США

Валютная пара	Метод заключения					Всего	Общее количество сделок
	Прямые сделки между дилерами	Прямые сделки с клиентами	Электронный брокер	Система эл-х торгов	Голосовой брокер		
Доллар США против							
Евро	13 319	61 033	48 255	43 269	32 791	198 667	46 511
Японская йена	9 357	32 442	22 767	26 541	18 706	109 813	30 766
Фунт стерлингов	6 551	24 549	20 100	22 808	15 570	89 578	20 937
Канадский доллар	6 185	18 238	16 019	8 619	12 102	61 163	12 713
Французский франк	2 939	10 955	9 313	8 500	5 880	37 587	13 111
Австралийский доллар	2 686	10 924	8 706	7 098	6 440	35 854	9 424
Аргентинский песо	106	195	7	81	181	570	72
Бразильский реал	1 408	2 957	427	785	4 324	9 901	1 164
Чилийский песо	394	703	38	317	532	1 984	260
Мексиканский песо	1 946	7 008	6 170	2 103	9 452	26 679	3 564
Другие валюты	5 436	20 160	9 647	9 544	14 030	58 817	12 933
Евро против							
Японской йены	3 046	9 395	4 742	5 719	2 280	25 182	11 299
Фунт стерлингов	638	3 496	4 008	3 017	1 590	12 749	4 535
Французский франк	593	2 609	3 290	3 785	1 628	11 905	4 146
Другие валютные пары	3 516	13 295	4 611	9 483	4 749	35 654	17 977
Всего	58 120	217 959	158 100	151 669	130 255	716 103	189 412

2d. FX Опционы, Средний объем за день

Миллионов долларов США

	Контрагент				
Валютная пара	Подотчетные Дилеры	Другие Дилеры	Другие финансовые Участники	Нефинансовые Участники	Всего
Доллар США против					
Евро	2 735	3 621	3 159	1 142	10 657
Японская йена	2 526	2 900	2 822	469	8 717
Фунт стерлингов	1 623	1 846	3 102	552	7 123
Канадский доллар	995	1 582	1 493	382	4 452
Французский франк	315	330	379	157	1 181
Австралийский доллар	529	723	1 050	290	2 592
Аргентинский песо	7	5	6	22	40
Бразильский реал	434	579	495	67	1 575
Чилийский песо	8	9	3	3	23
Мексиканский песо	337	838	515	143	1 833
Другие валюты	568	808	1 353	2 403	5 132
Евро против					
Японской йены	1 204	774	2 197	93	4 268
Фунт стерлингов	210	401	516	78	1 205
Французский франк	137	238	591	159	1 125
Другие валютные пары	843	1 185	1 517	333	3 878
Всего	12 471	15 839	19 198	6 293	53 801

2f. Средний объем за день, по методу заключения сделки, инструменту и контрагенту
Миллионов долларов США

Валютная пара	Метод заключения					Всего	Общее количество сделок
	Прямые сделки между дилерами	Прямые сделки с клиентами	Электронный брокер	Система эл-х торгов	Голосовой брокер		
ИНСТРУМЕНТ							
Сделки СПОТ	22 989	84 525	96 280	78 509	37 443	319 746	157 944
ФОРВАРДЫ Outright	4 501	44 749	8 183	31 288	20 382	109 103	23 043
FX СВОПЫ	17 149	54 812	46 879	37 527	64 624	220 991	5 711
FX ОПЦИОНЫ	13 483	33 875	6 759	4 346	7 806	66 269	2 716
Всего	58 122	217 961	158 101	151 670	130 255	716 109	189 414
КОНТРАГЕНТ							
Подотчетные дилеры	58 122	0	66 559	24 644	46 553	195 878	36 974
Банковские/другие дилеры	0	78 044	77 873	51 473	56 764	264 154	74 363
Др. финансовые клиенты	0	94 094	8 512	67 988	25 012	195 606	65 401
Нефинансовые клиенты	0	45 824	5 158	7 566	1 926	60 474	12 676
Всего	58 122	217 962	158 102	151 671	130 255	716 112	189 414

За. Сделки СПОТ, объем за месяц

Миллионов долларов США

КОНТРАГЕНТ

Валютная пара	Подотчетные дилеры	Др. дилеры	Др. Финансовые клиенты	Нефинансовые клиенты	Всего
Доллар США против					
Евро	295 190	892 368	476 469	117 212	1 781 239
Японская йена	147 623	378 455	238 696	55 616	820 390
Фунт стерлингов	116 104	331 028	216 569	42 109	705 810
Канадский доллар	71 218	137 257	75 439	38 896	322 810
Французский франк	54 566	154 388	100 384	17 703	327 041
Австралийский доллар	41 710	110 638	67 825	12 689	232 862
Аргентинский песо	791	778	1 210	211	2 990
Бразильский реал	5 628	10 595	11 225	3 234	30 682
Чилийский песо	3 729	3 375	5 052	903	13 059
Мексиканский песо	37 885	87 857	32 159	21 912	179 813
Другие валюты	48 146	107 377	134 291	50 933	340 747
Евро против					
Японской йены	40 565	170 412	91 679	10 936	313 592
Фунт стерлингов	26 673	82 120	34 056	15 679	158 528
Французский франк	27 277	86 106	46 988	9 528	169 899
Другие валютные пары	44 623	108 015	105 170	95 847	353 655
Всего	961 728	2 660 769	1 637 212	493 408	5 753 117

3б. ФОРВАРДЫ OUTRIGHT,объем за месяц

Миллионов долларов США

КОНТРАГЕНТ

Валютная пара	Подотчетные дилеры	Др. дилеры	Др. финансовые клиенты	Нефинансовые клиенты	Всего
Доллар США против					
Евро	34 424	93 479	325 317	106 443	559 663
Японская йена	15 799	71 833	156 715	47 049	291 396
Фунт стерлингов	16 535	47 632	111 941	40 085	216 193
Канадский доллар	7 036	22 973	62 909	38 762	131 680
Французский франк	6 567	16 998	40 205	16 858	80 628
Австралийский доллар	9 584	27 072	63 030	13 800	113 486
Аргентинский песо	1 352	2 177	1 370	505	5 404
Бразильский реал	17 855	40 642	38 317	7 751	104 565
Чилийский песо	4 178	9 937	2 755	843	17 713
Мексиканский песо	6 422	18 812	15 196	17 754	58 184
Другие валюты	32 807	78 410	133 781	52 065	297 063
Евро против					
Японской йены	4 486	11 299	16 555	10 032	42 372
Фунт стерлингов	1 147	4 272	7 347	14 212	26 978
Французский франк	1 323	3 978	6 599	7 764	19 664
Другие валютные пары					
	9 175	29 204	60 534	58 765	157 678
Всего	168 690	478 718	1 042 571	432 688	2 122 667

Зс. FX СВОПЫ, объем за месяц

Миллионов долларов США

КОНТРАГЕНТ

Валютная пара	Подотчетные дилеры	Др. дилеры	Др. финансовые клиенты	Нефинансовые клиенты	Всего
Доллар США против					
Евро	151 514	549 424	300 938	66 933	1 068 809
Японская йена	125 524	359 330	154 337	30 096	669 287
Фунт стерлингов	73 930	308 044	162 788	24 185	568 947
Канадский доллар	121 059	251 428	106 817	36 965	516 269
Французский франк	42 915	140 848	56 499	5 997	246 259
Австралийский доллар	31 986	161 695	58 240	5 906	257 827
Аргентинский песо	97	159	79	11	346
Бразильский реал	1 067	2 119	2 483	297	5 966
Чилийский песо	614	1 039	78	0	1 731
Мексиканский песо	44 951	101 108	35 103	6 368	187 530
Другие валюты	59 643	179 142	84 980	13 345	337 110
Евро против					
Японской йены	1 305	2 678	5 753	1 931	11 667
Фунт стерлингов	1 264	1 378	11 538	9 275	23 455
Французский франк	598	963	1 158	2 040	4 759
Другие валютные пары	8 236	15 741	44 014	8 303	76 294
Всего	664 703	2 075 096	1 024 805	211 652	3 976 256

3d. FX ОПЦИОНЫ, объем за месяц

Миллионов долларов США

КОНТРАГЕНТ

Валютная пара	Подотчетные дилеры	Др. дилеры	Др. финансовые клиенты	Нефинансовые клиенты	Всего
Доллар США против					
Евро	57 442	76 048	66 329	23 981	223 800
Японская йена	53 054	60 898	59 260	9 849	183 061
Фунт стерлингов	34 083	38 776	65 133	11 593	149 585
Канадский доллар	20 892	33 230	31 358	8 026	93 506
Французский франк	6 612	6 925	7 956	3 295	24 788
Австралийский доллар	11 101	15 183	22 058	6 091	54 433
Аргентинский песо	149	107	126	468	850
Бразильский реал	9 123	12 160	10 386	1 413	33 082
Чилийский песо	171	187	66	66	490
Мексиканский песо	7 070	17 589	10 814	3 010	38 483
Другие валюты	11 931	16 972	28 421	50 468	107 792
Евро против					
Японской йены	25 288	16 263	46 131	1 950	89 632
Фунт стерлингов	4 416	8 416	10 837	1 632	25 301
Французский франк	2 880	4 992	12 421	3 337	23 630
Другие валютные пары	17 703	24 886	31 855	6 998	81 442
Всего	261 915	332 632	403 151	132 177	1 129 875

3е. Общий объем за месяц, по методу заключения сделок и валютной паре
Миллионов долларов США

Валютная пара	Метод заключения					Всего	Общее количество сделок
	Прямые сделки между дилерами	Прямые сделки с клиентами	Электронный брокер	Система эл-х торгов	Голосовой брокер		
Доллар США против							
Евро	279 693	1 281 689	1 013 364	908 651	688 619	4 172 016	976 734
Японская йена	196 507	681 281	478 113	557 353	392 824	2 306 078	646 082
Фунт стерлингов	137 571	515 539	422 094	478 968	326 967	1 881 139	439 683
Канадский доллар	129 886	382 996	336 401	180 998	254 136	1 284 417	266 977
Французский франк	61 725	230 050	195 573	178 495	123 482	789 325	275 329
Австралийский доллар	56 413	229 410	182 821	149 057	135 235	752 936	197 913
Аргентинский песо	2 232	4 094	140	1 698	3 800	11 964	1 512
Бразильский реал	29 575	62 106	8 968	16 494	90 805	207 948	24 445
Чилийский песо	8 270	14 760	800	6 666	11 173	41 669	5 469
Мексиканский песо	40 876	147 171	129 578	44 168	198 493	560 286	74 838
Другие валюты	114 157	423 368	202 589	200 434	294 637	1 235 185	271 589
Евро против							
Японской йены	63 975	197 304	99 592	120 101	47 880	528 852	237 282
Фунт стерлингов	13 391	73 421	84 170	63 354	33 386	267 722	95 239
Французский франк	12 452	54 789	69 091	79 479	34 190	250 001	87 074
Другие валютные пары	73 843	279 203	96 837	199 153	99 729	748 765	377 518
Всего	1 220 566	4 577 181	3 320 131	3 185 069	2 735 356	15 038 303	3 977 684

3f. Средний объем за месяц, по методу заключения сделки, инструменту и контрагенту
Миллионов долларов США

Валютная пара	Метод заключения					Общее количество сделок	
	Прямые сделки между дилерами	Прямые сделки с клиентами	Электронный брокер	Система эл-х торгов	Голосовой брокер		
ИНСТРУМЕНТ							
Сделки СПОТ	482 771	1 775 022	2 021 888	1 648 680	786 303	6 714 664	3 316 824
ФОРВАРДЫ Outright	94 524	939 730	171 846	657 050	428 028	2 291 178	483 902
FX СВОПЫ	360 126	1 151 047	984 462	788 071	1 357 110	4 640 816	119 923
FX ОПЦИОНЫ	283 146	711 384	141 931	91 275	163 919	1 391 655	57 039
Всего	1 220 567	4 577 183	3 320 127	3 185 076	2 735 360	15 038 313	3 977 688
КОНТРАГЕНТ							
Подотчетные дилеры	1 220 564	0	1 397 731	517 524	977 616	4 113 435	776 450
Банковские/другие дилеры	0	1 638 914	1 635 327	1 080 927	1 192 045	5 547 213	1 561 628
Др. финансовые клиенты	0	1 975 973	178 761	1 427 748	525 262	4 107 744	1 373 418
Нефинансовые клиенты	0	962 298	108 309	158 876	40 440	1 269 923	266 190
Всего	1 220 564	4 577 185	3 320 128	3 185 075	2 735 363	15 038 315	3 977 686

4а. ФОРВАРДЫ OUTRIGHT, объем за месяц по дате возврата

Миллионов долларов США

Валютная пара	Срок возврата		
	меньше одного месяца	от месяца до года	больше одного года
Доллар США против			
Евро	386 524	203 157	4 385
Японская йена	196 944	108 231	2 005
Фунт стерлингов	118 844	112 537	1 338
Канадский доллар	70 901	65 085	2 715
Французский франк	53 783	33 199	198
Австралийский доллар	67 181	55 432	442
Аргентинский песо	2 389	3 501	859
Бразильский реал	84 273	36 241	1 899
Чилийский песо	11 847	10 028	11
Мексиканский песо	38 517	25 120	955
Другие валюты	165 358	156 865	7 640
Евро против			
Японской йены	32 320	14 166	356
Фунт стерлингов	19 546	8 401	164
Французский франк	15 008	5 271	697
Другие валютные пары	108 176	58 304	362
Всего	1 371 611	895 538	24 026

4b. FX СВОПЫ, объем за месяц по дате возврата

Миллионов долларов США

Валютная пара	Срок возврата		
	меньше одного месяца	от месяца до года	больше одного года
Доллар США против			
Евро	988 546	224 451	7 311
Японская йена	668 638	118 039	8 118
Фунт стерлингов	508 587	132 738	1 537
Канадский доллар	546 469	87 626	3 216
Французский франк	238 426	48 710	2 028
Австралийский доллар	244 959	44 184	657
Аргентинский песо	353	78	10
Бразильский реал	2 771	4 222	37
Чилийский песо	1 304	1 019	20
Мексиканский песо	195 655	32 218	4 590
Другие валюты	326 487	67 699	2 552
Евро против			
Японской йены	9 357	3 333	275
Фунт стерлингов	16 205	8 469	36
Французский франк	3 865	860	630
Другие валютные пары	58 816	25 029	682
Всего	3 810 438	798 675	31 699

4с. FX ОПЦИОНЫ, объем за месяц по дате возврата

Миллионов долларов США

Валютная пара	Срок возврата		
	меньше одного месяца	от месяца до года	больше одного года
Доллар США против			
Евро	123 547	129 831	27 846
Японская йена	102 117	88 694	45 290
Фунт стерлингов	89 566	85 458	8 633
Канадский доллар	59 235	48 944	6 209
Французский франк	14 723	13 044	3 626
Австралийский доллар	35 720	25 535	4 269
Аргентинский песо	50	429	520
Бразильский реал	10 421	17 896	13 880
Чилийский песо	155	458	47
Мексиканский песо	13 498	23 316	8 731
Другие валюты	64 208	41 500	14 008
Евро против			
Японской йены	42 497	62 665	9 745
Фунт стерлингов	20 938	7 191	1 578
Французский франк	8 525	15 003	2 976
Другие валютные пары			
	38 999	45 227	14 910
Всего	624 199	605 191	162 268