

An aerial photograph of a city at sunset. The sky is filled with colorful clouds in shades of orange, red, and blue. The city below is densely packed with buildings, and a wide river flows through the foreground. The overall scene is vibrant and dynamic.

Отчёты биржи для ЭМИТЕНТОВ: КЛЮЧЕВЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ

ТАТЬЯНА КОХЕНДЕРФЕР

Департамент биржевой информации и технологических услуг

08.08.2023

ОТЧЁТЫ БИРЖИ ДЛЯ ЭМИТЕНТОВ

I. Планы по развитию Отчёта по бумаге эмитента

данные о торгах бумагой эмитента
на Московской бирже

1: Информация по бумаге.....
2: Статистика по ФЛ держателям бумаги
2.1: Структура держателей НП
3: Оборот по клиентам
Объем по клиентам (Покупка).....
Объем по клиентам (Продажа).....
4: Кол-во клиентов и доля участников
4.1: Объем торгов: основной режим и РЕПО
5: Позиции участников по оборотам.....
6 : Позиции участников по оборотам по типам клиентов
НФТ-клиенты
Нерезиденты (non-НФТ)
Прочие резиденты (non-НФТ)
Резиденты-физлица (non-НФТ)
7: Позиции участников по algo-клиентам
8: Динамика средней цены
9: Динамика риск-параметра
Глоссарий

ОСЕНЬ:

ДОБАВЛЕНИЕ БЕНЧМАРКОВ по сектору и рынку, в т.ч.

- Величина и структура оборотов
- Структура владения
- Оборачиваемость FF
- Время держания бумаги
- И др.

II. Новый продукт Отчёт по инвесторам ФЛ эмитента

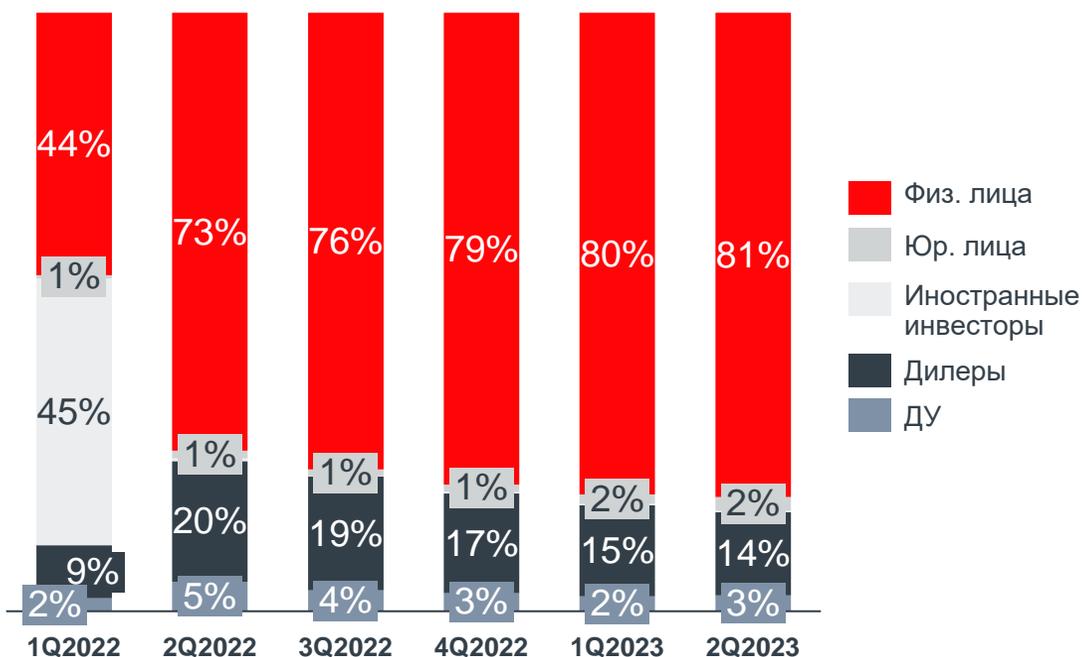
данные о профиле клиентов ФЛ эмитента на
основе операций ФЛ с бумагой эмитента на
Московской бирже

2	Определения
3	Кол-во клиентов и обороты
4	Портфель по рыночному грейду
5	Портфель по грейду по бумаге
6	Выход клиентов из бумаги
7	Концентрация владения ФЛ
8	Стратегии клиентов
9	Рэнкинги брокеров
10	Состав портфеля клиентов XXXX

НОВЫЙ ОТЧЁТ ПО КЛИЕНТАМ ФЛ ЭМИТЕНТА

С 2 кв. 2022 г. ФЛ создают основную часть оборотов на рынке акций и обеспечивают ликвидность

Структура оборота по клиентским группам



Видим, что приоритетной задачей для многих эмитентов стало выстроить работу с массовым инвестором.

Задачи, которые помогает решать отчёт:



Выбор каналов и формата коммуникации с инвесторами ФЛ, в зависимости от состоятельности и опытности инвесторов



Выбор брокера для работы с разными сегментами ФЛ



Оценка профиля клиентов ФЛ относительно рынка



Отслеживать результаты работы с ФЛ



Оперативно отвечать на запросы менеджмента

ГРЕЙДЫ СОСТОЯТЕЛЬНОСТИ ИНВЕСТОРОВ

Грейд инвестора обозначает диапазон, в котором находится сумма средств, вложенных клиентом физическим лицом (ФЛ) в бумагу эмитента / в фондовый рынок Московской биржи.

Рыночный грейд – диапазон, в котором находится сумма средств, вложенных клиентом ФЛ в инструменты фондового рынка (ФР) Московской биржи: рынок акций и долговой рынок.

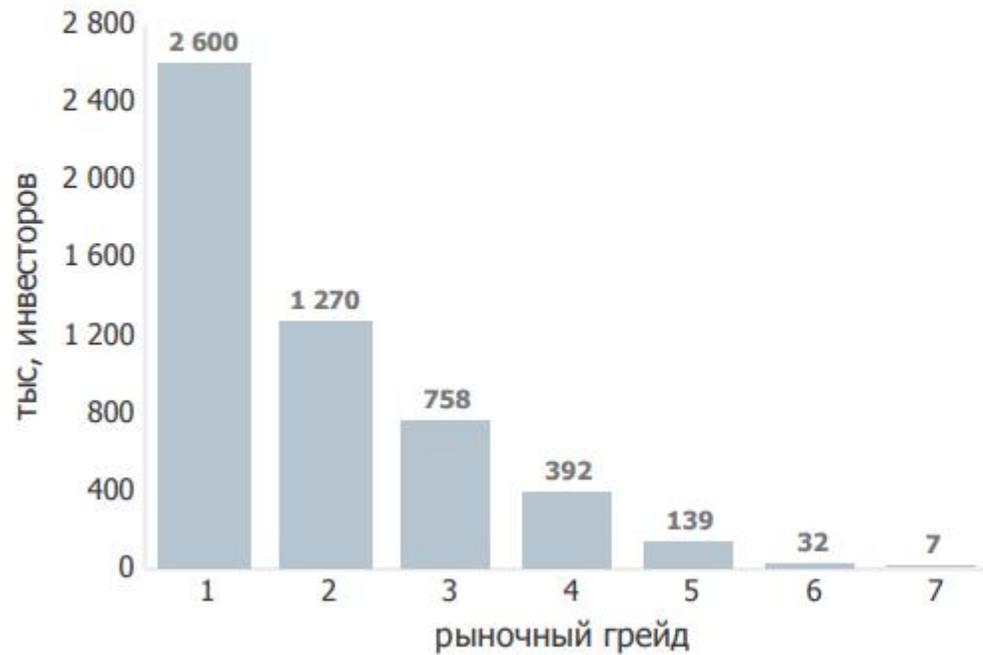
Грейд владения бумагой – диапазон, в котором находится сумма средств, вложенных клиентом ФЛ в бумагу эмитента.

Классификация клиентов ФЛ по грейдам:

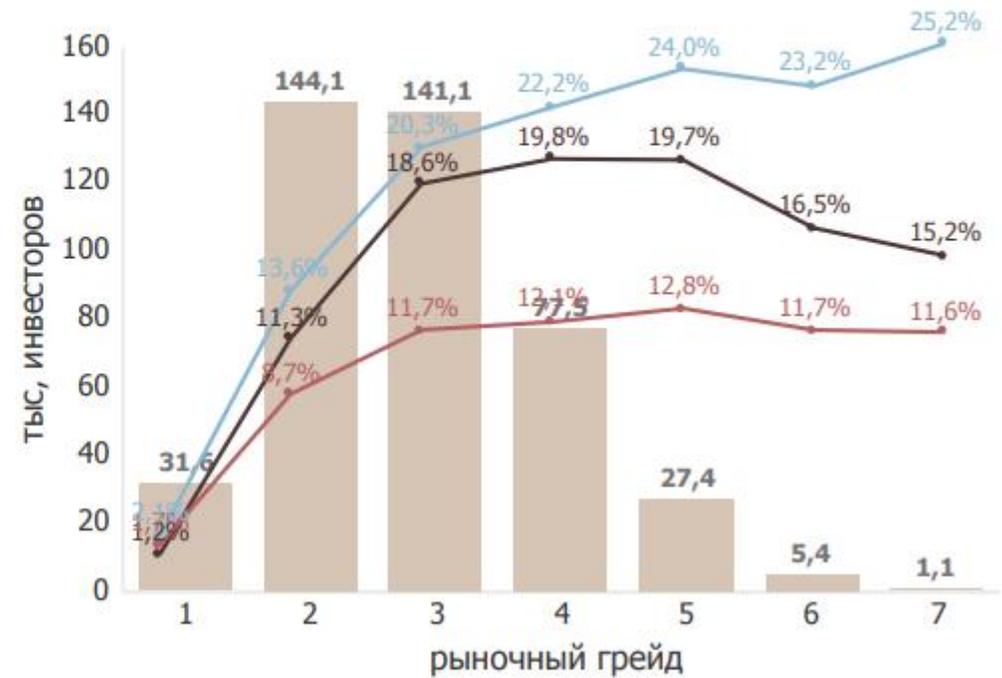
Рыночный грейд/Грейд владения бумагой	Размер портфеля ФР на Московской бирже
1	до 10 000 руб.
2	10 000 - 100 000 руб.
3	100 000 - 500 000 руб.
4	500 000 руб. - 2 млн руб.
5	2 - 10 млн руб.
6	10 - 50 млн руб.
7	более 50 млн руб.

Доля клиентов от всех инвесторов на рынке: ■ Индекс голубых фишек ■ Компании сектора ■ XXXX

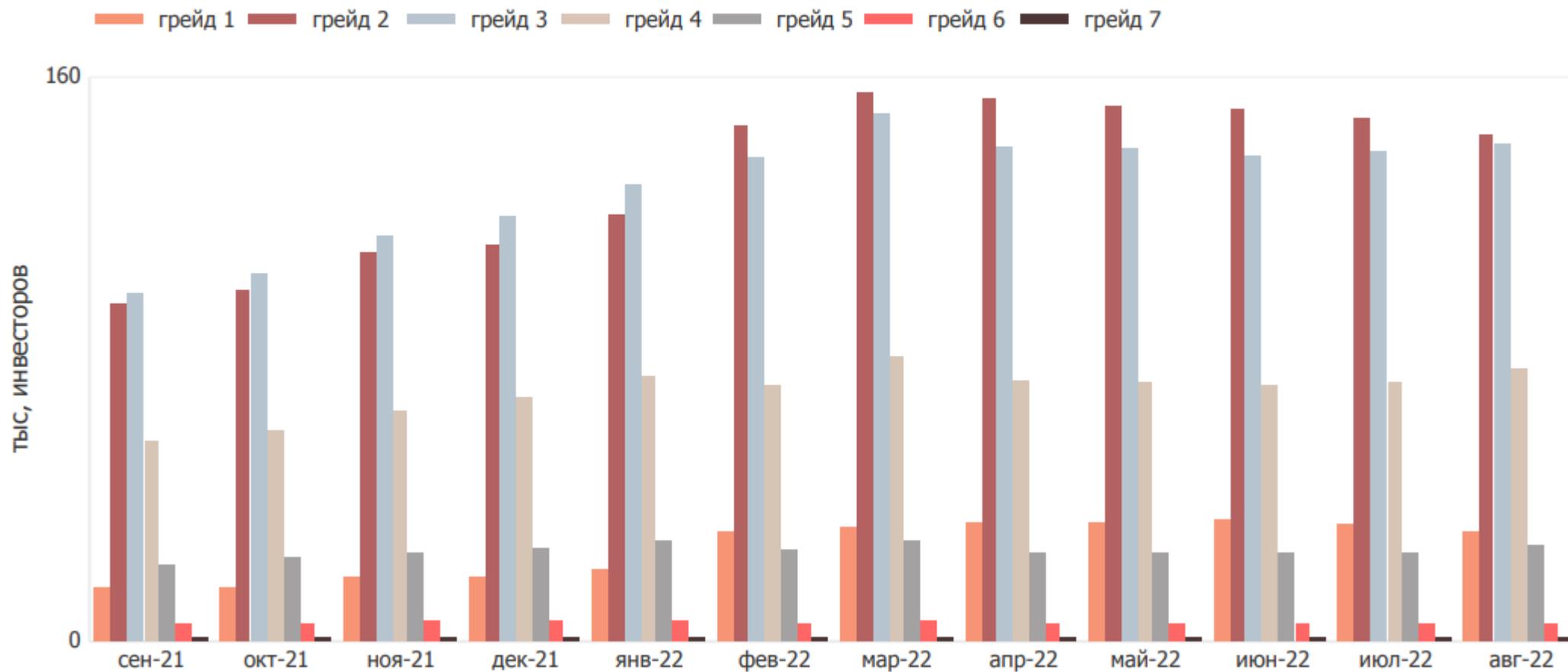
Кол-во инвесторов ФЛ на рынке



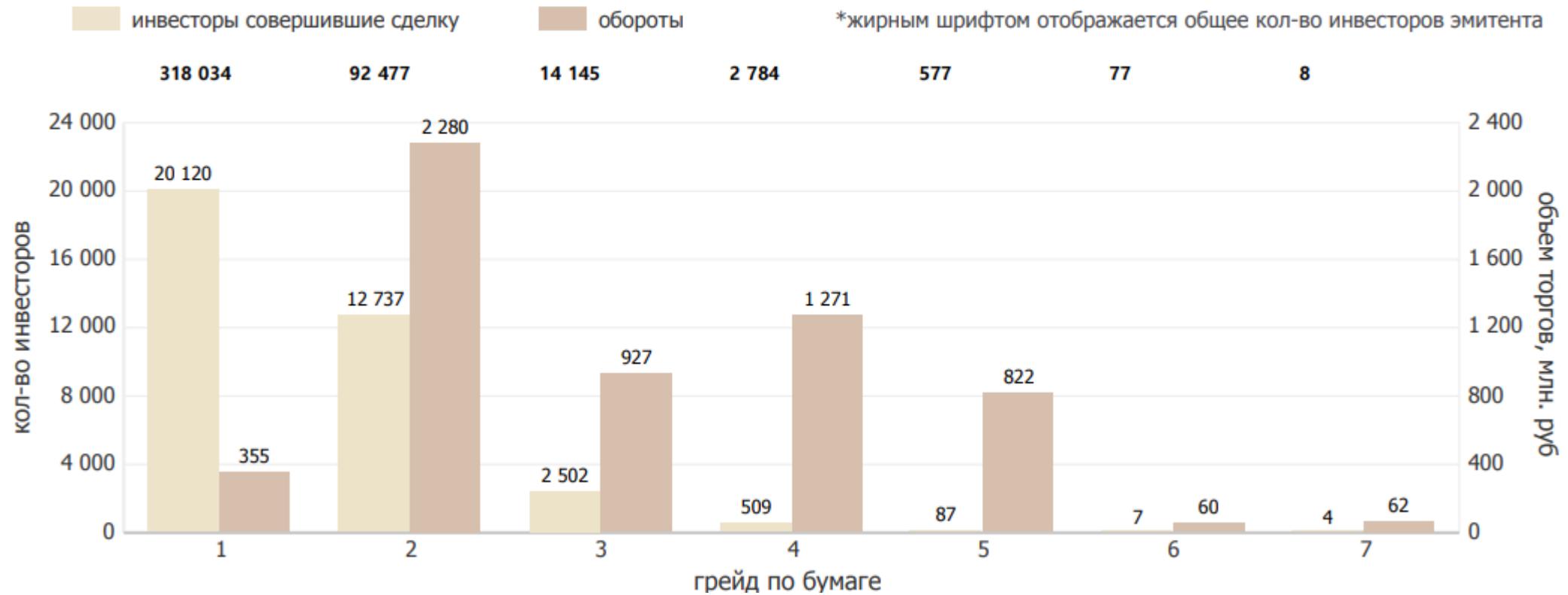
Кол-во инвесторов ФЛ XXXX



Кол-во инвесторов каждого грейда в динамике 12 мес по бумаге ХХХХ



Кол-во инвесторов и обороты каждого грейда по бумаге XXXX



ПОРТФЕЛЬ ИНВЕСТОРОВ ПО РЫНОЧНОМУ ГРЕЙДУ

Отчёт по клиентам ФЛ эмитента

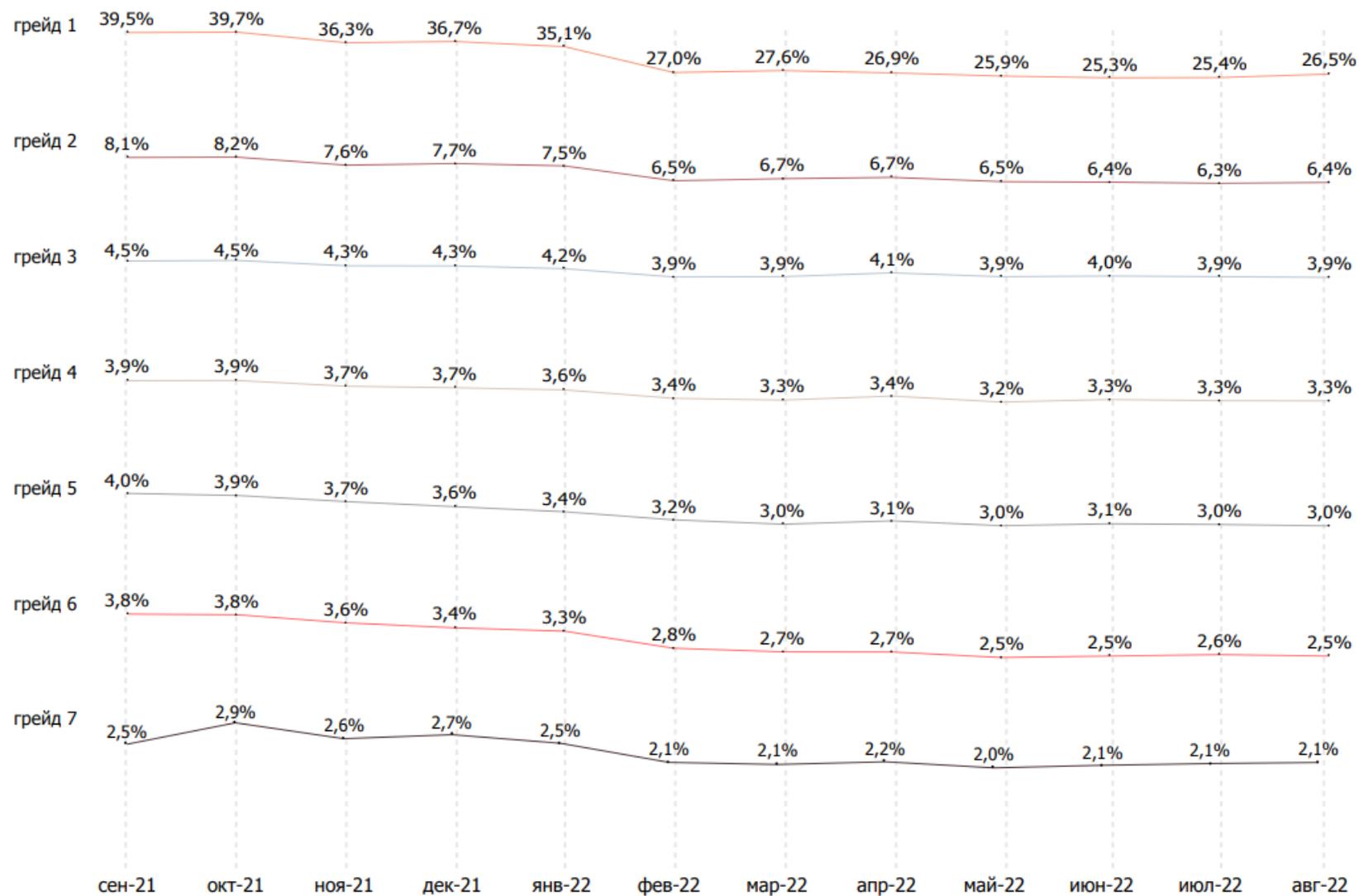
Размер портфеля на фондовом рынке

Рыночный грейд	Объем, руб	Среднее, руб	Медиана, руб
1	156 502 584	4 955	4 868
2	6 644 176 210	46 122	41 774
3	34 448 647 871	244 135	218 532
4	75 886 348 561	978 850	868 714
5	111 397 587 771	4 068 427	3 395 773
6	107 176 081 985	19 958 302	16 522 774
7	200 470 613 928	185 620 939	91 018 996

Размер владения бумагой ХХХХ

Рыночный грейд	Объем, руб	Среднее, руб	Медиана, руб	Доля в портфеле ФР	Доля по сектору
1	41 437 507	1 312	905	26,5%	36,5%
2	424 749 623	2 949	1 810	6,4%	11,2%
3	1 349 899 720	9 567	4 525	3,9%	6,6%
4	2 488 617 237	32 100	13 575	3,3%	5,2%
5	3 327 161 186	121 514	49 775	3,0%	5,1%
6	2 710 035 713	504 662	199 100	2,5%	5,2%
7	4 289 006 137	3 971 302	905 000	2,1%	4,8%

ДОЛЯ БУМАГ ЭМИТЕНТА В ПОРТФЕЛЕ ФОНДОВОГО РЫНКА ПО РЫНОЧНЫМ ГРЕЙДАМ



ПОРТФЕЛЬ ИНВЕСТОРОВ ПО ГРЕЙДУ ПО БУМАГЕ

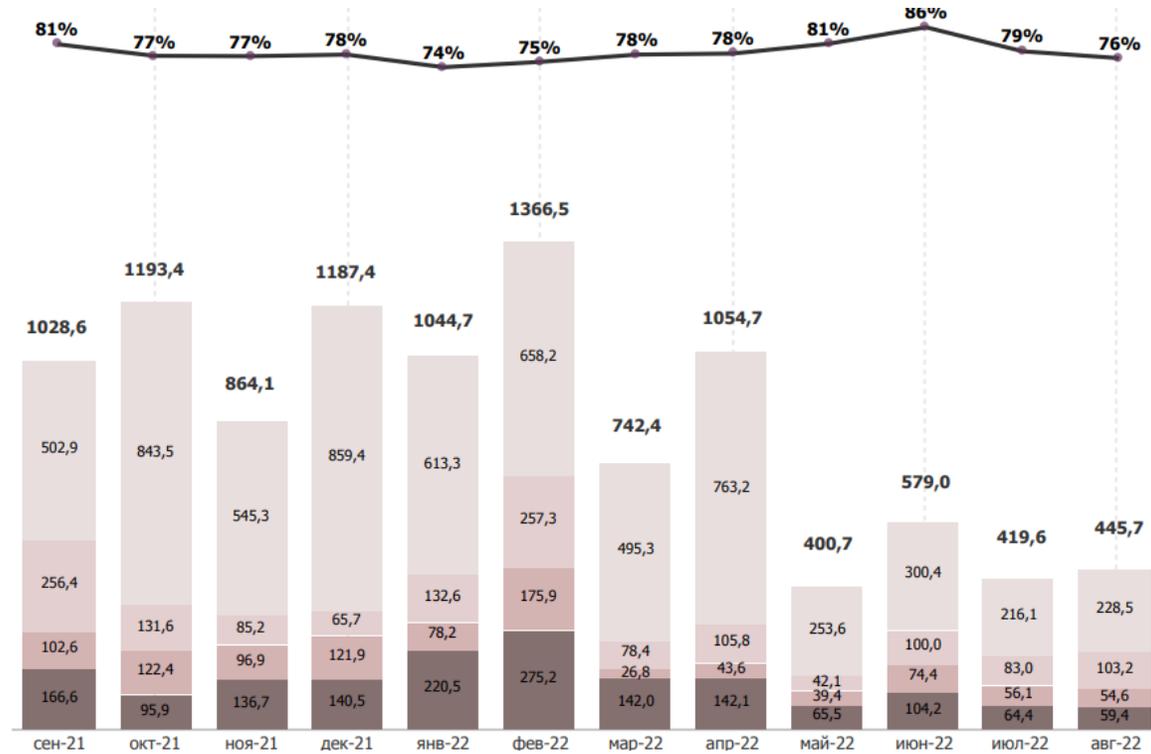
Грейд по бумаге	Медиана портфеля, руб	Медиана объема бумаги в портфеле, руб	Доля бумаги	Доля по сектору
1	87 496	1 810	1,0%	15,2%
2	690 825	23 530	2,1%	17,1%
3	3 226 860	181 000	2,7%	26,1%
4	10 857 920	814 500	3,4%	34,2%
5	37 140 030	3 176 550	3,4%	40,4%
6	151 627 661	15 982 300	3,9%	43,9%
7	405 461 720	126 847 063	15,5%	49,2%



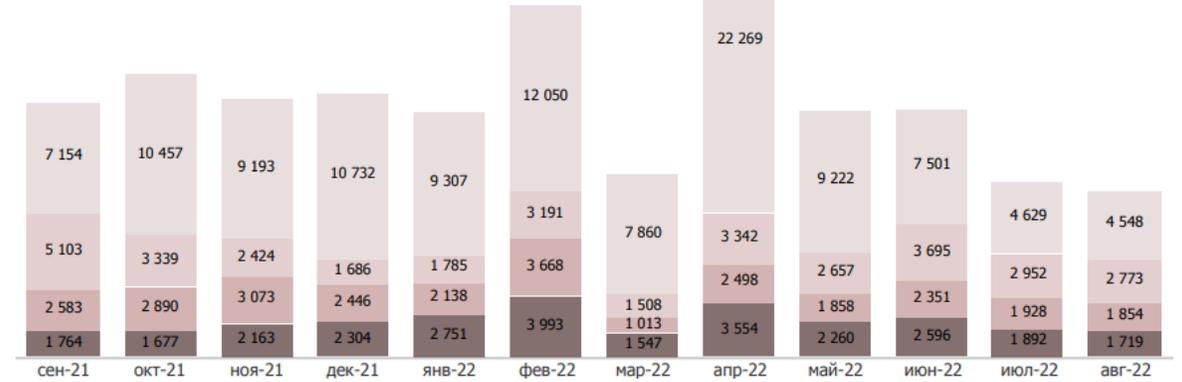
Длительность владения:



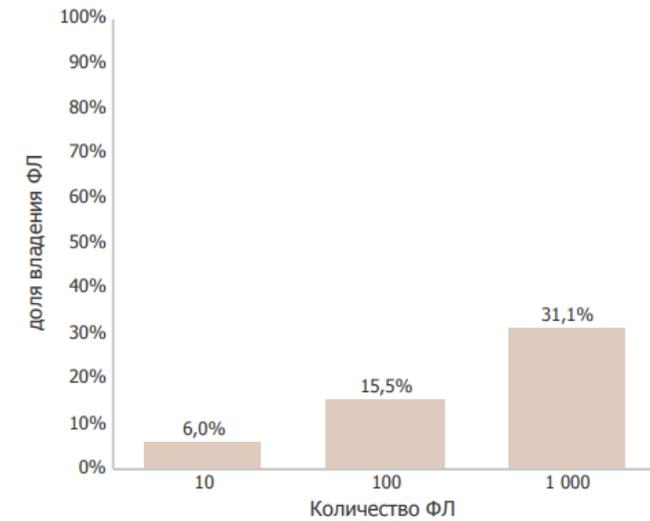
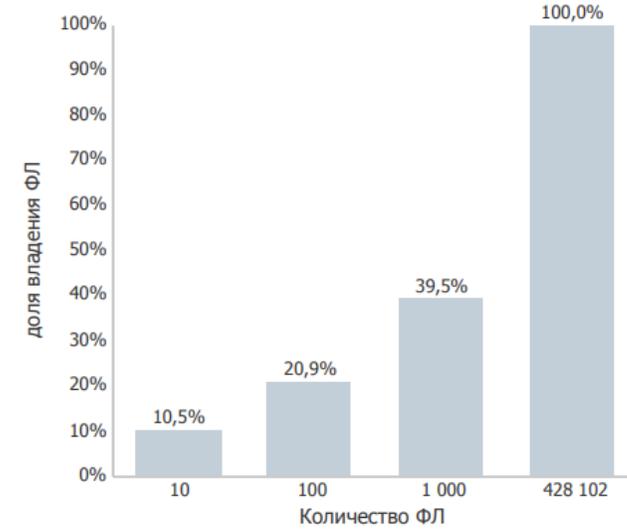
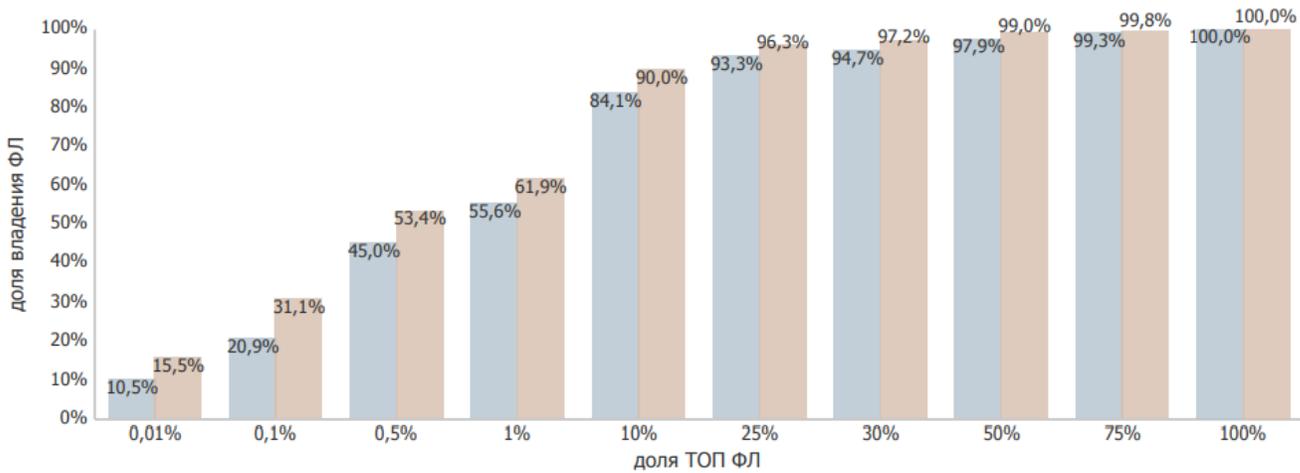
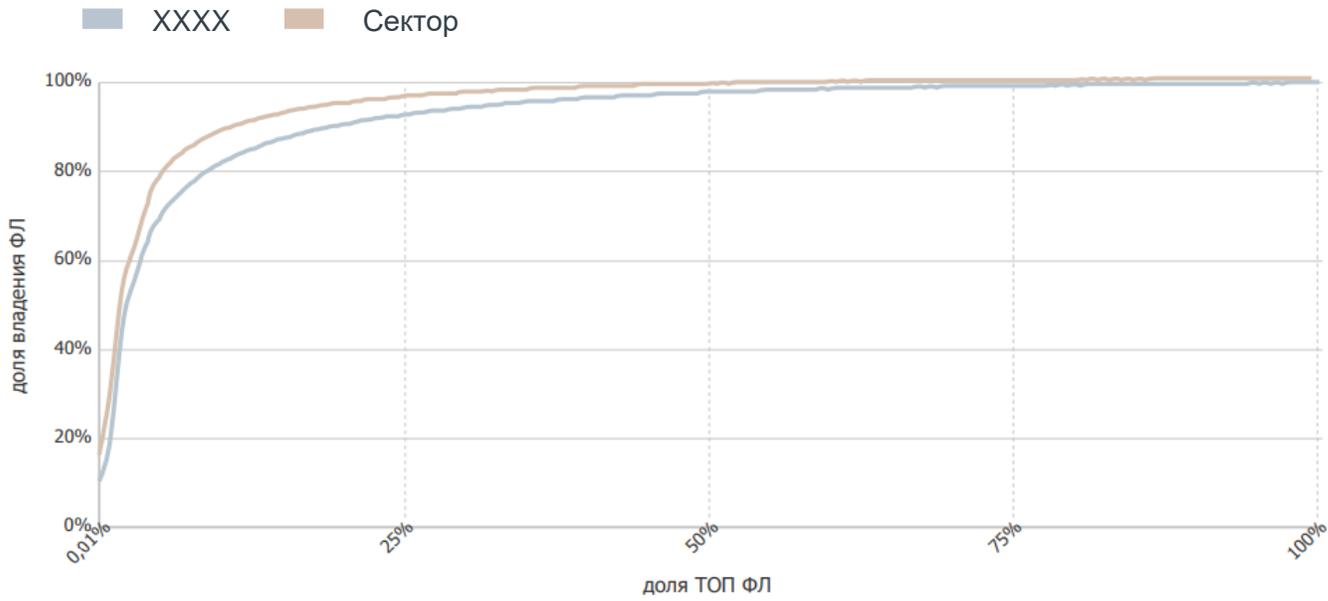
Объёмы продаж бумаги более 90% от владения



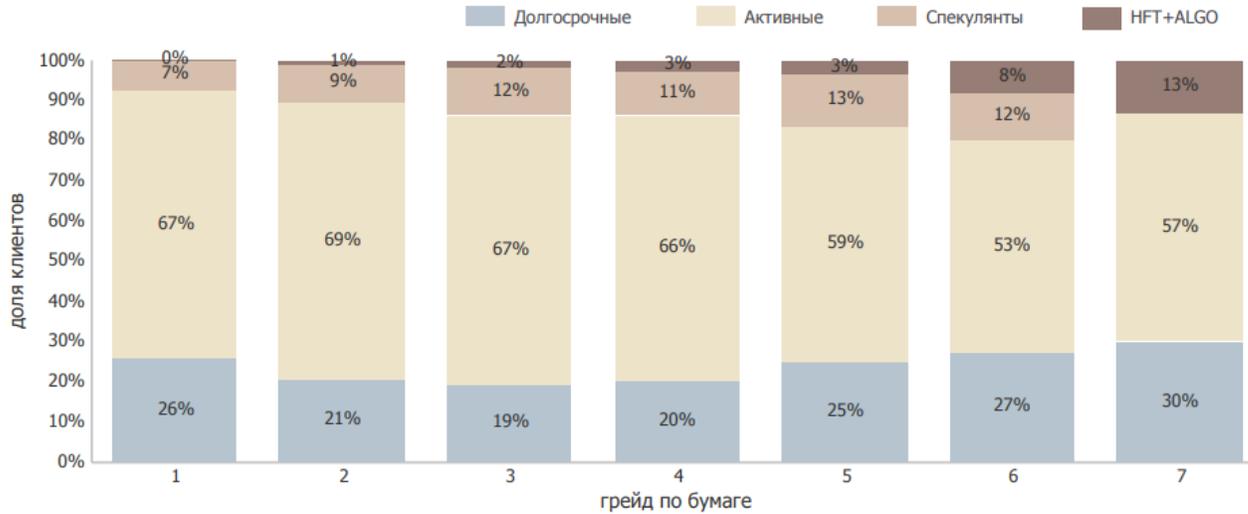
Количество клиентов, кто продал более 90% владения бумагой эмитента



КОНЦЕНТРАЦИЯ КЛИЕНТОВ ФЛ



Доли клиентов владения бумагой по грейдам в разбивке по стратегиям за отчётный месяц



HFT – клиенты, у которых хотя бы в один из дней фиксировалась HFT активность (10 000+ заявок) на рынке акций.

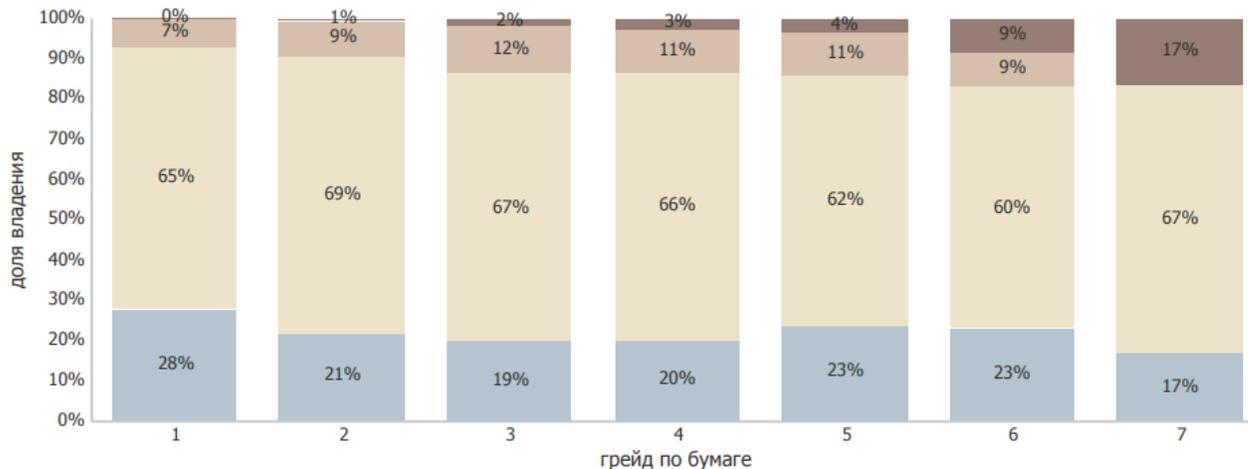
ALGO – клиенты, у которых хотя бы в один из дней фиксировалась АЛГО активность (от 1 000 до 10 000 заявок) на рынке акций.

Спекулянты – клиенты, не относящиеся к HFT+ALGO, у которых была хотя бы 1 сделка в 90%+ торговых дней.

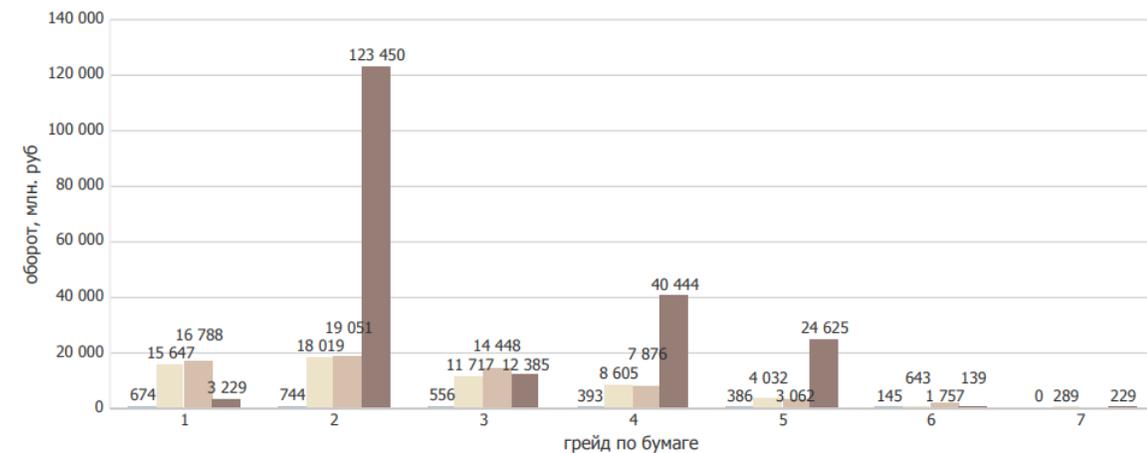
Активные инвесторы – клиенты, не относящиеся к HFT+ALGO и спекулянтам, у которых была хотя бы 1 сделка в 5-90% торговых дней.

Долгосрчные инвесторы – все остальные клиенты, у которых была хотя бы 1 сделка в < 5% торговых дней.

Доли объема владения бумагой по грейдам в разбивке по стратегиям за отчётный месяц



Обороты по грейдам в разбивке по стратегиям за отчётный месяц



РЭНКИНГИ БРОКЕРОВ В РАЗРЕЗЕ ГРЕЙДОВ

Рэнкинги брокеров по объёмам, проходящим через них, в разрезе грейдов							
Рыночный грейд							
Объем ТОП-5	1 94,1%	2 84,7%	3 85,0%	4 87,5%	5 88,7%	6 86,5%	7 89,1%
1	АО "Тинькофф Банк"	АО "Тинькофф Банк"	АО "Тинькофф Банк"	АО "Тинькофф Банк"	АО "Тинькофф Банк"	ООО Брокерская компания Платформа	ООО "Ренессанс Брокер"
2	ПАО Сбербанк	ПАО Сбербанк	Банк ВТБ (ПАО)	ПАО Сбербанк	ПАО Сбербанк	АО "Открытие Брокер"	АО "ИК "Ай Ти Инвест"
3	АО "АЛЬФА-БАНК"	АО "ФИНАМ", АО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	ООО "АТОН"	Банк ВТБ (ПАО)	ООО "Компания БКС"	АО "ИК "Ай Ти Инвест"	АО "Открытие Брокер"
4	Банк ВТБ (ПАО)	Банк ВТБ (ПАО)	ПАО Сбербанк	ООО "Компания БКС"	Банк ВТБ (ПАО)	АО "Тинькофф Банк"	АО "ФИНАМ", АО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"
5	ООО "Компания БКС"	ООО "Компания БКС"	ООО "Компания БКС"	АО "ФИНАМ", АО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	АО "ФИНАМ", АО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	Банк ВТБ (ПАО)	Банк ВТБ (ПАО)

РЭНКИНГИ БРОКЕРОВ В РАЗРЕЗЕ КАТЕГОРИЙ КЛИЕНТОВ

Рэнкинги брокеров по объёмам, проходящим через них, в разрезе категорий клиентов				
Объем Топ-5	Долгосрочные 87,6%	Активные 86,4%	Спекулянты 78,8%	HFT+ALGO 97,8%
1	АО "Тинькофф Банк"	АО "Тинькофф Банк"	ПАО Сбербанк	АО "Открытие Брокер"
2	Банк ВТБ (ПАО)	ПАО Сбербанк	АО "Тинькофф Банк"	ООО Брокерская компания Платформа
3	ПАО Сбербанк	Банк ВТБ (ПАО)	Банк ВТБ (ПАО)	АО "ИК "Ай Ти Инвест"
4	АО "ФИНАМ", АО "Инвестиционная компания "ФИНАМ"	АО "АЛЬФА-БАНК"	АО "АЛЬФА-БАНК"	ООО "Ренессанс Брокер"
5	ООО "Компания БКС"	ООО "Компания БКС"	ООО "Компания БКС"	ООО "Компания БКС"

СОСТАВ ПОРТФЕЛЯ ИНВЕСТОРОВ ЭМИТЕНТА

Фин. инструмент		Тип инструмента	Сумма в НП, руб	Доля, %	Ранг
ГАЗПРОМ ао	GAZP	Акции российских эмитентов обыкновенные	6 130 223 668	7,41%	1
Сбербанк	SBER	Акции российских эмитентов обыкновенные	3 088 311 299	3,73%	2
ГМКНорНик	GMKN	Акции российских эмитентов обыкновенные	2 748 738 840	3,32%	3
ЛУКОЙЛ	LKOH	Акции российских эмитентов обыкновенные	2 573 977 350	3,11%	4
Сбербанк-п	SBERP	Акции российских эмитентов привилегированные	2 003 714 619	2,42%	5
RUS-28	XS0088543193	Еврооблигации	1 802 825 219	2,18%	6
Yandex cIA	YNDX	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 577 184 007	1,91%	7
МТС-ао	MTSS	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 446 919 722	1,75%	8
МосБиржа	MOEX	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 445 811 348	1,75%	9
Магнит ао	MGNT	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 382 502 410	1,67%	10
Новатэк ао	NVTK	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 299 873 905	1,57%	11
ФосАгро ао	PHOR	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 295 535 242	1,57%	12
Роснефть	ROSN	Акции российских эмитентов обыкновенные	1 253 096 672	1,51%	13
RUS-26	RU000A0JWHA4	Еврооблигации	1 189 334 242	1,44%	14
Сургнфгз-п	SNGSP	Акции российских эмитентов привилегированные	1 029 710 115	1,24%	15

...

...

...

...

...

...

Количество квалифицированных инвесторов

	Кол-во инвесторов	Кол-во бумаг	Объем владения, руб
Квалифицированные	63 315	104 263 342	9 435 832 451
Все	428 102	161 667 482	14 630 907 121

Давность последней сделки

Давность посл. сделки	Кол-во инвесторов
Более 12 мес назад	109 342
Более 6 и менее 12 мес назад	166 682
Более 3 и менее 6 мес назад	78 751
Более 1 и менее 3 мес назад	38 822
менее месяца	34 505

СРАВНЕНИЕ ДВУХ ОТЧЁТОВ ДЛЯ ЭМИТЕНТОВ

Продукты содержат
разные данные и
являются
комплементарными

	ОТЧЁТ ПО БУМАГЕ ЭМИТЕНТА	ОТЧЁТ ПО КЛИЕНТАМ ФЛ ЭМИТЕНТА
Клиенты	Эмитенты акций и ДР, торгующихся на Московской бирже	
Способ предоставления	Через ЛКЭ	
Формат предоставления	pdf + excel	
Способ приобретения	По подписке ежемесячно	По подписке ежемесячно / раз в квартал
Состав данных:		
Рассматриваемые клиенты	ЮЛ, ФЛ, резиденты, нерезиденты	ФЛ
Позиции в рейтингах относительно других компаний	есть	нет
Обороты	по режимам торгов, по категориям клиентов, медиана дневного объёма	по грейдам*, по стратегиям клиентов
Кол-во клиентов	активные по категориям	по грейдам*, доля от кол-ва на рынке
Владение	бумагой по категориям клиентов	по грейдам*: размер портфеля ФР, владение бумагой, средний портфель
Доля бумаги в портфеле	нет	есть
Время держания бумаги	есть	нет
География владения по ФЛ	есть	нет
Информация по сделкам РЕПО	есть	нет
Сравнение с индексами	с индексом Мосбиржи	Отраслевые индексы, индекс Голубых фишек
Обороты по ТОП брокерам	по категориям клиентов	по грейдам*, по стратегиям клиентов ФЛ
Рейтинги брокеров	по категориям клиентов	по грейдам*, по стратегиям клиентов ФЛ
Концентрация владения	нет	есть
Выход клиентов из бумаги	нет	есть
Полный состав портфеля клиентов	нет	есть
Кол-во квалифицированных инвесторов	нет	есть

* Грейд клиента обозначает диапазон, в котором находится сумма средств, вложенных клиентом физическим лицом (ФЛ) в бумагу эмитента / в фондовый рынок Московской биржи

An aerial photograph of a city at sunset. The sky is filled with vibrant orange, red, and blue clouds. The city below is densely packed with buildings, and a large river flows through the center. The overall scene is dramatic and colorful.

УПРАВЛЯЕМ ТЕМ, ЧТО ОТСЛЕЖИВАЕМ!

КОНТАКТЫ ДЛЯ
ПОДКЛЮЧЕНИЯ УСЛУГ
И ПРЕДЛОЖЕНИЙ ПО
РАЗВИТИЮ АНАЛИТИКИ:

IssuersReports@moex.com
+7 (495) 363-3232 ДОБ. 5656