



ФЬЮЧЕРС НА ИНДЕКС RGBI

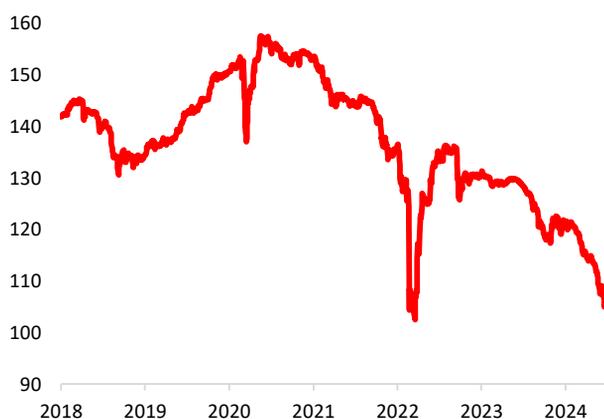
[ПОДРОБНЕЕ](#)

ОПИСАНИЕ ИНДЕКСА

ИНДЕКС ГОСУДАРСТВЕННЫХ ОБЛИГАЦИЙ МОСКОВСКОЙ БИРЖИ (RGBI – RUSSIAN GOVERNMENT BOND INDEX) – ОСНОВНОЙ ИНДИКАТОР РЫНКА РОССИЙСКОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО ДОЛГА. ОН ВКЛЮЧАЕТ НАИБОЛЕЕ ЛИКВИДНЫЕ ОБЛИГАЦИИ ФЕДЕРАЛЬНОГО ЗАЙМА С ДЮРАЦИЕЙ БОЛЕЕ ОДНОГО ГОДА, РАССЧИТЫВАЕТСЯ В РЕЖИМЕ РЕАЛЬНОГО ВРЕМЕНИ ПО МЕТОДАМ СОВОКУПНОГО ДОХОДА И ЧИСТЫХ ЦЕН.

Архив ребалансировок доступен по [ссылке](#)

ДИНАМИКА ИНДЕКСА RGBI, пунктов



СВОДНАЯ ИНФОРМАЦИЯ ПО ИНДЕКСУ RGBI

КОД ИНДЕКСА	RGBI
КОЛИЧЕСТВО ОБЛИГАЦИЙ В СПИСКЕ	ПЕРЕМЕННОЕ
ВРЕМЯ РАСЧЕТА (МСК)	С 10:00 ДО 19:00
ПЕРИОДИЧНОСТЬ РАСЧЕТА ИНДЕКСА	1 РАЗ В 15 СЕКУНД
ДАТА НАЧАЛЬНОГО ЗНАЧЕНИЯ	31.12.2002
НАЧАЛЬНОЕ ЗНАЧЕНИЕ	100
ДЮРАЦИЯ БУМАГ, ВХОДЯЩИХ В ИНДЕКС	ОТ 1 ГОДА
СРОКИ ИЗМЕНЕНИЯ СПИСКА ИНДЕКСА	ПЕРВЫЙ РАБОЧИЙ ДЕНЬ МАРТА, ИЮНЯ, СЕНТЯБРЯ И ДЕКАБРЯ

ОПИСАНИЕ ФЬЮЧЕРСА

НАИМЕНОВАНИЕ КОНТРАКТА	РАСЧЕТНЫЙ ФЬЮЧЕРСНЫЙ КОНТРАКТ НА ИНДЕКС RGBI
КОД КОНТРАКТА	RGBI-<МЕСЯЦ ИСПОЛНЕНИЯ>.<ГОД ИСПОЛНЕНИЯ>
ЦЕНА КОНТРАКТА	ЗНАЧЕНИЕ ИНДЕКСА RGBI * 100
МИНИМАЛЬНЫЙ ШАГ ЦЕНЫ	1 ПУНКТ
СТОИМОСТЬ МИНИМАЛЬНОГО ШАГА ЦЕНЫ	1 РУБЛЬ
ПЕРИОДИЧНОСТЬ ЛИСТИНГА	КВАРТАЛЬНАЯ
ПОСЛЕДНИЙ ДЕНЬ ТОРГОВ	ПЕРВЫЙ ТОРГОВЫЙ ДЕНЬ МАРТА, ИЮНЯ, СЕНТЯБРЯ И ДЕКАБРЯ
КОЛИЧЕСТВО СРОКОВ В ТОРГАХ	2
ВРЕМЯ ЗАВЕДЕНИЯ СЛЕДУЮЩЕГО СРОКА	ПОСЛЕ 15 ФЕВРАЛЯ, 15 МАЯ, 15 АВГУСТА И 15 НОЯБРЯ
ИСПОЛНЕНИЕ	ЦЕНА ЗАКРЫТИЯ ИНДЕКСА RGBI В ДЕНЬ, ПРЕДШЕСТВУЮЩИЙ ПОСЛЕДНЕМУ ТОРГОВОМУ ДНЮ КОНТРАКТА В ДНЕВНОЙ КЛИРИНГ

ОСНОВНЫЕ ФАКТОРЫ, ВЛИЯЮЩИЕ НА ДИНАМИКУ ИНДЕКСА RGBI:

- ИНФЛЯЦИЯ И ДЕНЕЖНО-КРЕДИТНАЯ ПОЛИТИКА БАНКА РОССИИ.** ПРИ РОСТЕ ИНФЛЯЦИИ БАНК РОССИИ СТРЕМИТСЯ К УЖЕСТОЧЕНИЮ ДКП. ПОВЫШЕНИЕ КЛЮЧЕВОЙ СТАВКИ ПРИВОДИТ К РОСТУ ДОХОДНОСТИ ОБЛИГАЦИЙ И ЗНАЧЕНИЕ ИНДЕКСА ИМЕЕТ ТЕНДЕНЦИЮ К СНИЖЕНИЮ. ПРИ СНИЖЕНИИ ИНФЛЯЦИИ ПРОИСХОДИТ ОБРАТНЫЙ ПРОЦЕСС, КЛЮЧЕВАЯ СТАВКА СНИЖАЕТСЯ, ИНДЕКС ПОКАЗЫВАЕТ ПОЛОЖИТЕЛЬНУЮ ДИНАМИКУ.
- ОЖИДАНИЯ ПО САНКЦИЯМ НА РОССИЙСКИЙ ДОЛГ И ПРИТОКИ/ОТТОКИ СРЕДСТВ НЕРЕЗИДЕНТОВ В ОФЗ.** ЗАВИСИМОСТЬ ПРЯМАЯ – ПРИТОКИ СО СТОРОНЫ НЕРЕЗИДЕНТОВ ПРИВОДЯТ К РОСТУ ЦЕН НА РОССИЙСКИЙ ГОС. ДОЛГ, ЧТО ПРИВОДИТ К РОСТУ ИНДЕКСА
- КОРРЕЛЯЦИЯ С МИРОВЫМИ ДОЛГОВЫМИ РЫНКАМИ,** В ЧАСТНОСТИ С РЫНКОМ США. РОСТ ДОХОДНОСТЕЙ НА АМЕРИКАНСКОМ ДОЛГОВОМ РЫНКЕ МОЖЕТ ПРИВОДИТЬ К СНИЖЕНИЮ ИНДЕКСА RGBI

