

Индекс	Значение 01.06.12	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 298,08	1,29%	-10,23%	-18,66%	-21,36%
Индекс РТС	1 227,65	-3,54%	-21,76%	-28,77%	-34,59%
Индекс RTS Standard	9 011,63	1,94%	-9,62%	-17,71%	-19,44%
Отраслевые индексы (руб.значения)					
Нефть и газ	2 749,35	0,81%	-9,84%	-17,31%	-10,12%
Электроэнергетика	1 584,09	-3,74%	-21,17%	-34,15%	-41,28%
Потребительский сектор	4 227,92	0,28%	-13,20%	-14,32%	-21,26%
Телекоммуникации	1 899,27	-1,94%	-12,51%	-18,45%	-21,68%
Машиностроение	1 747,42	-2,38%	-17,13%	-15,77%	-27,20%
Финансы	4 362,41	-1,33%	-14,17%	-21,81%	-28,70%
Химия и нефтехимия	6 850,23	1,40%	-8,33%	-8,37%	1,61%
Металлы и добыча	2 678,09	0,50%	-13,09%	-25,92%	-49,05%
Капитализационные индексы					
Высокая кап-я	2 089,66	0,94%	-9,47%	-18,30%	-21,10%
Стандартная кап-я	2 135,29	-0,40%	-13,28%	-20,53%	-29,07%
Базовая кап-я	3 107,45	-1,35%	-15,42%	-21,39%	-36,43%
Тематические индексы					
Индекс волатильности	45,78	1,55%	45,70%	37,89%	69,93%
Индекс РТС Сибирь	635,74	0,00%	-13,60%	-17,59%	-29,98%
Индекс ММВБ Инновации	663,11	-0,60%	-9,94%	-12,96%	-31,34%
Курс доллара (Ц/б РФ)					
USD / RUB	32,92	4,11%	12,13%	13,40%	17,66%

На прошедшей неделе Индекс ММВБ повысился на 1,29% до 1 298,08 (1 281,6 на 25 мая 2012г.).

Долларовый Индекс РТС понизился на 3,54% до 1 227,65 (1 272,69 на 25 мая 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю повысился на 4,11%.

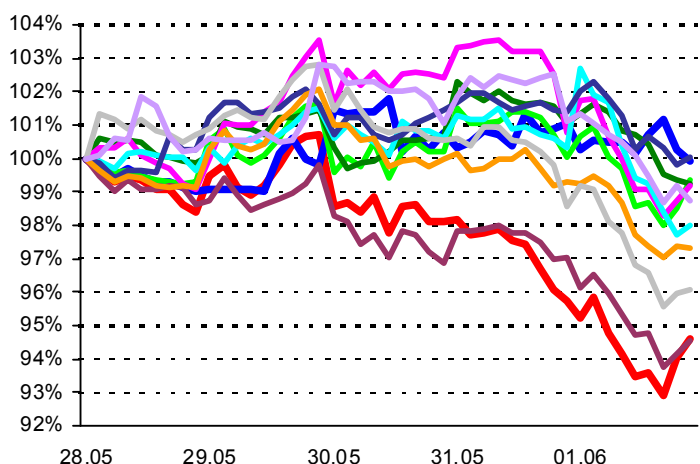
На фондовом рынке наблюдалось повышение волатильности: Российский индекс волатильности вырос на 1,55% до 45,78 пункта (45,09 пункта на 25 мая 2012г.).

На прошедшей неделе ключевые секторы экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали разнонаправленную динамику. Лидером понижения стала электроэнергетика: падение по отраслевому индексу составило 3,74%. Также понижение продемонстрировали машиностроение и телекоммуникации - Индекс машиностроения понизился на 2,38%, а Индекс телекоммуникаций потерял в весе 1,94%. Наибольший рост был отмечен в химии и нефтехимии - Индекс химии и нефтехимии повысился на 1,40%.

Индекс ММВБ Инновации понизился на 0,60%.

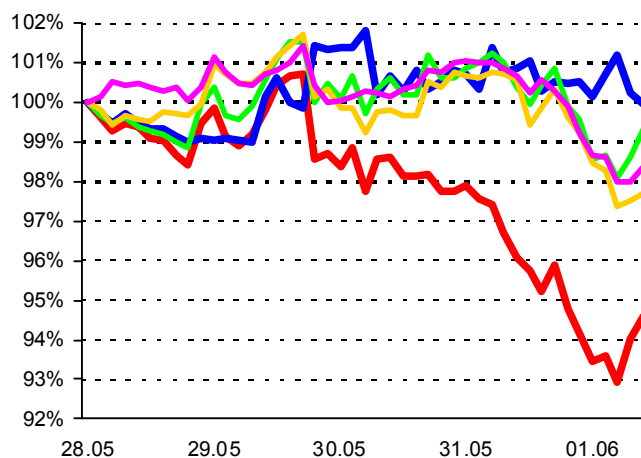
В наибольшей степени падение рынка акций затронуло небольшие по капитализации компании - Индекс компаний базовой капитализации потерял в весе 1,35%, тогда как Индекс компаний стандартной капитализации понизился всего на 0,40%, а Индекс высокой капитализации вырос на 0,94%.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



— Индекс РТС
— Нефть и газ
— Металлы и добыча
— Химия и нефтехимия
— Финансы
— Инновации
— Индекс ММВБ
— Потребительский сектор
— Машиностроение
— Электроэнергетика
— Телекоммуникации

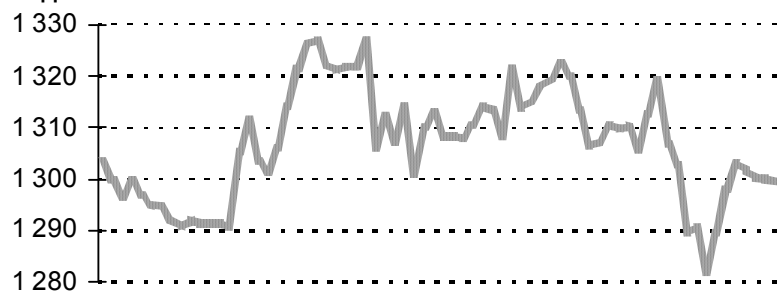
КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ



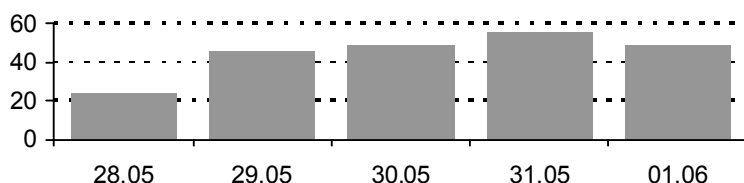
— Индекс РТС
— Высокая капит-я
— Базовая капит-я
— Индекс ММВБ
— Стандартная капит-я

Индекс ММВБ

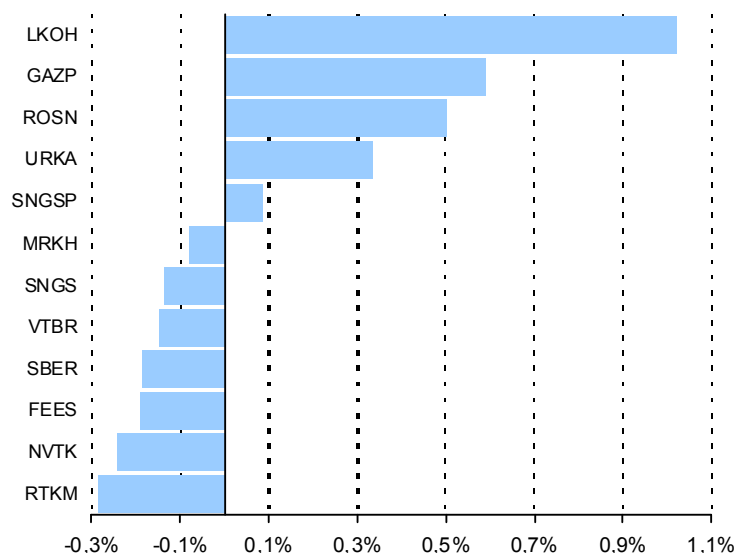
Индекс ММВБ



Объем торгов (осн.), млрд.руб.



Влияние на Индекс ММВБ, %



За неделю с 28 мая по 1 июня 2012г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику. Индекс ММВБ повысился на 1,29% до 1 298,08 (1 281,60 на 25 мая 2012г). По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 10,23% ниже своего закрытия месяц назад (1 446,04 на 2 мая 2012г) и находился на 21,36% ниже аналогичного показателя год назад (1 650,68 на 1 июня 2011г).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил 220,40 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец недели составила 17 401, 8 млрд. руб.

По итогам недели 13 из 30 акций, входящих в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику положительное воздействие (+2,72%), 17 ценных бумаг повлияли отрицательно (-1,43%).

Наибольший вклад в повышение Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (+1,75%) и химического производства (+0,34%).

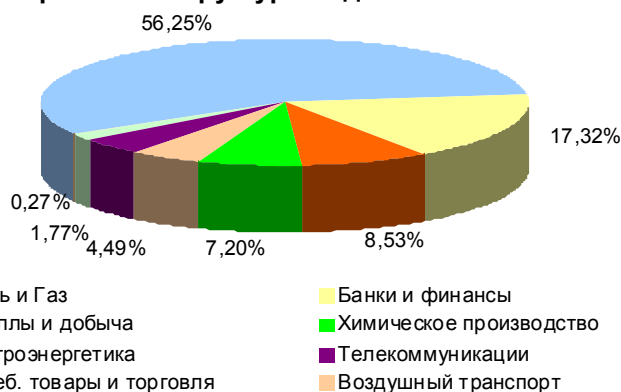
Наибольшее позитивное влияние на Индекс ММВБ оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО Лукойл (+1,02%), ОАО Газпром (+0,59%) и ОАО Роснефть (+0,50%).

Наиболее негативно на динамике Индекса ММВБ отразилось понижение цен обыкновенных акций ОАО Ростелеком (-0,29%).

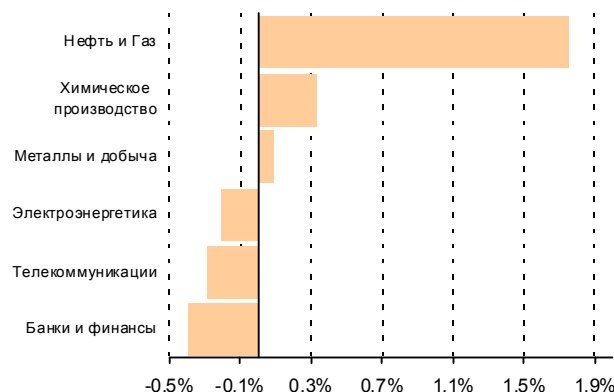
На нефтегазовый сектор приходится 56,25% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 17,32%) и металлургия (8,53%).

Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	13	17	0	30
Влияние, %	+2,72%	-1,43%	0%	+1,29%

Отраслевая структура Индекса ММВБ

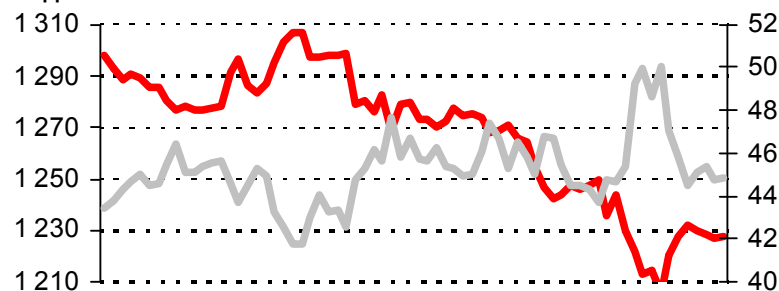


Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %

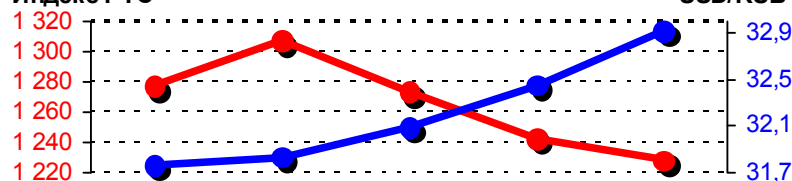


Индекс РТС

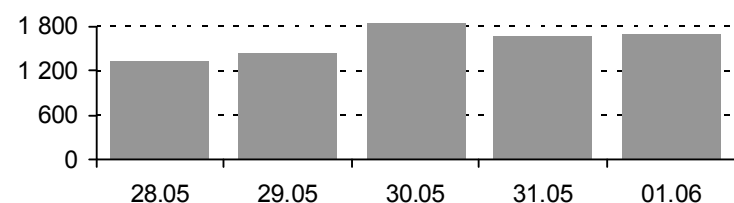
Индекс РТС



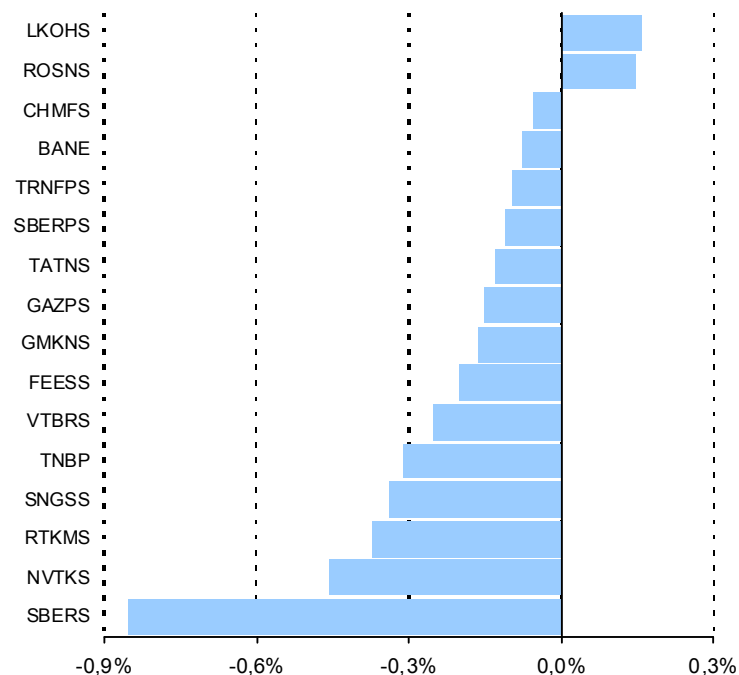
Индекс РТС



Объем торгов Standard&Classica, млн.долл.



Влияние на Индекс РТС, %



Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	4	28	18	50
Влияние, %	+0,32%	-3,86%	0%	-3,54%

За неделю с 28 мая по 1 июня 2012г. Индекс РТС упал на 3,54% до 1 227,65 (1 272,69 на 25 мая 2012г.). По состоянию на конец недели Индекс РТС был на 21,76% ниже своего закрытия месяц назад (1 569,10 на 2 мая 2012г) и находился на 34,59% ниже аналогичного показателя год назад (1 876,81 на 1 июня 2011г).

Снижение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось повышением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX вырос на 1,55%.

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю повысился на 4,11%.

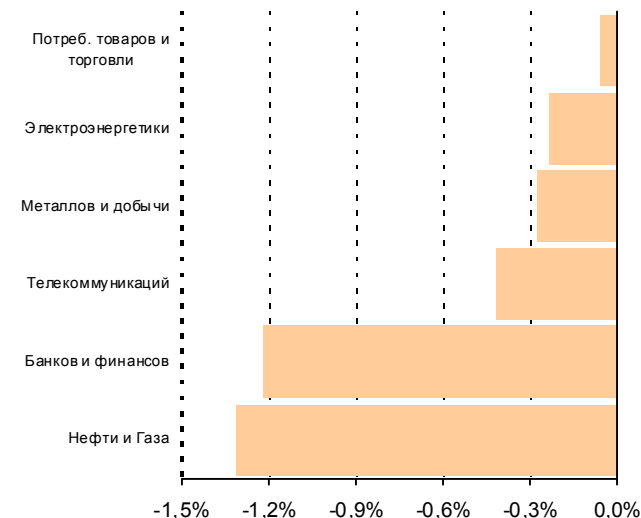
По итогам недели 28 из 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-3,86%), 4 ценные бумаги повлияли положительно (+0,32%), цена 18 ценных бумаг не изменилась.

Наибольший вклад в снижение Индекса РТС по итогам недели внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (-1,31%) и финансов (-1,22%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс РТС оказало снижение цен на обыкновенные акции ОАО Сбербанк России (-0,85%), ОАО Новатэк (-0,46%) и ОАО Ростелеком (-0,37%).

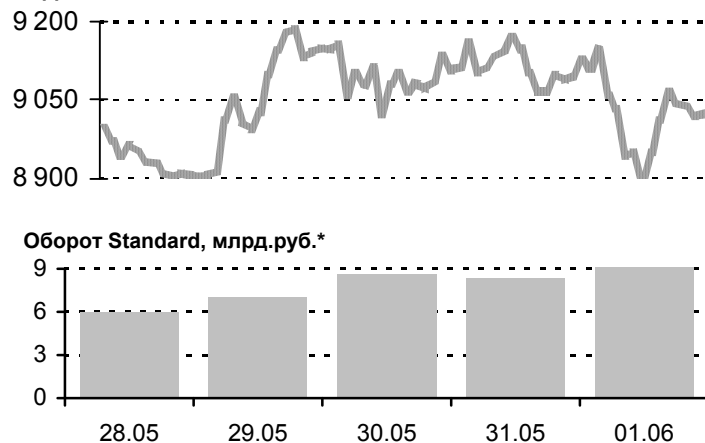
Наиболее позитивно на динамике Индекса РТС отразилось повышение цен обыкновенных акций ОАО Лукойл (+0,16%).

Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %



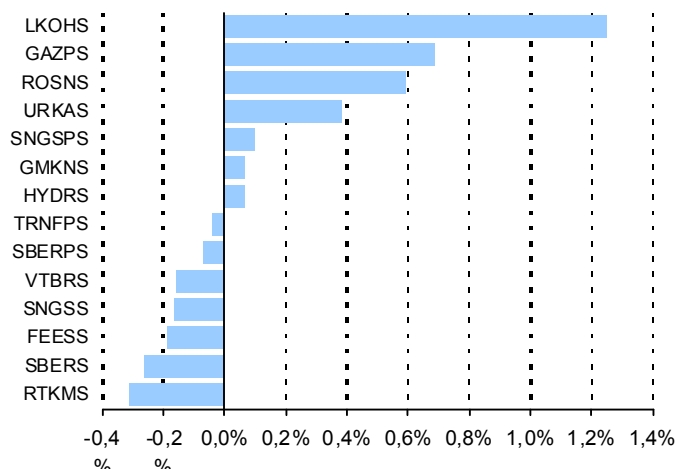
Индекс RTS Standard

Индекс RTS Standard



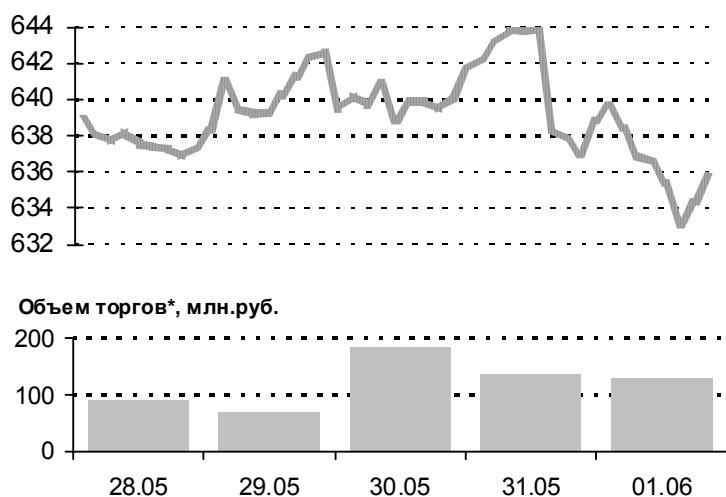
* по акциям из состава Индекса RTS Standard

Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %



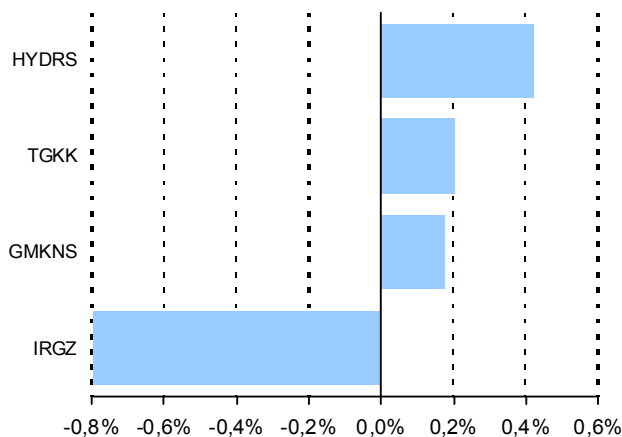
Индекс РТС Сибирь

Индекс РТС Сибирь



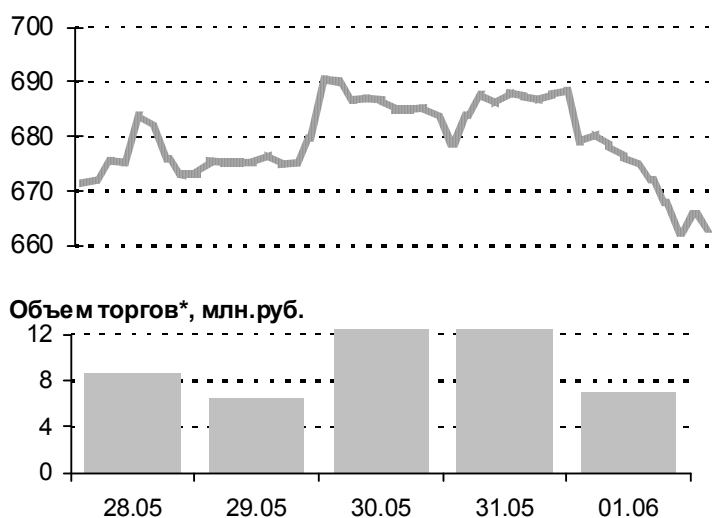
* по акциям из состава Индекса РТС Сибирь

Лидеры влияния на Индекс РТС Сибирь, %



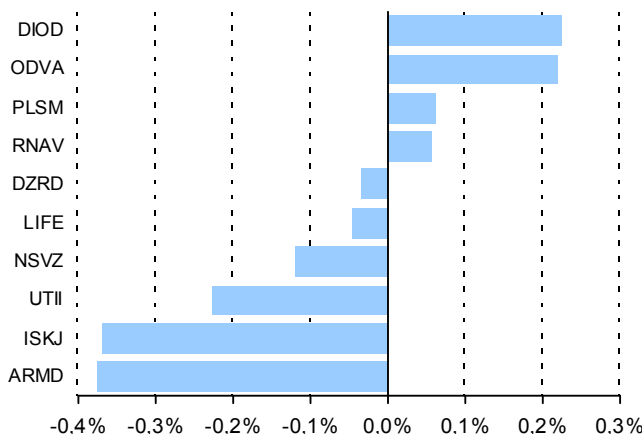
Индекс ММВБ Инновации

Индекс ММВБ Инновации

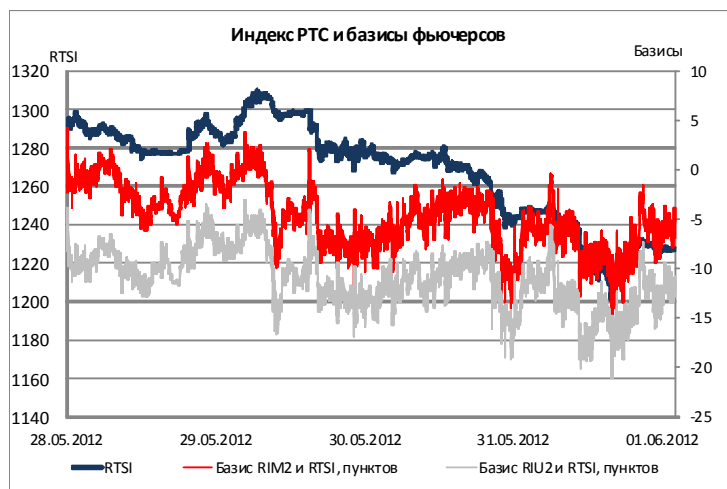


* по акциям из состава Индекса ММВБ инновации

Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



Производные на индексы



За неделю с 28 мая по 1 июня 2012г. объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 682,95 млрд. рублей или 8,23 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 621,85 млрд. рублей или 7,51 млн. контрактов.

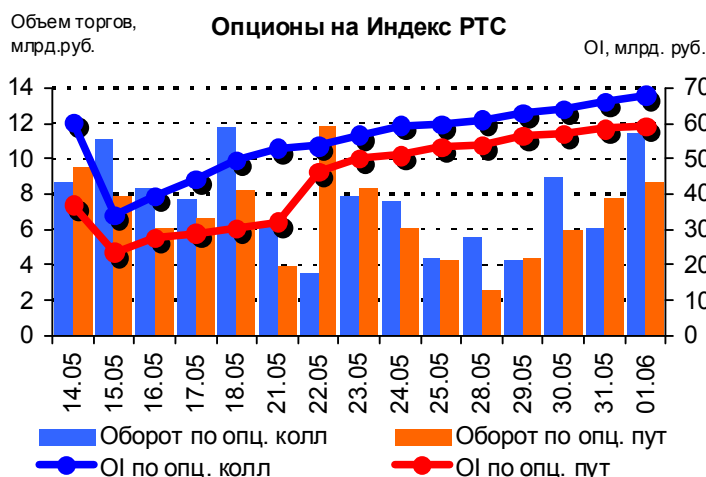
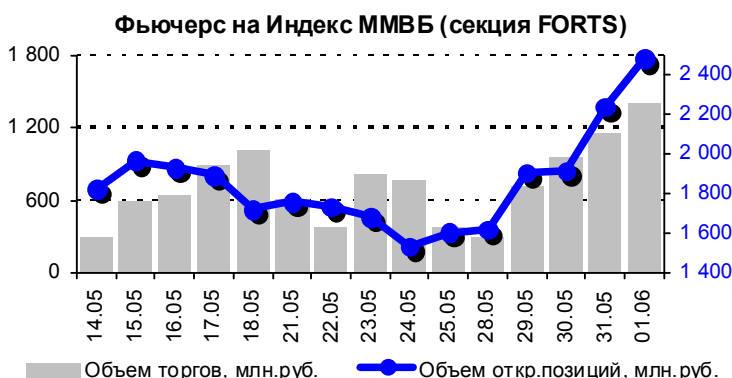
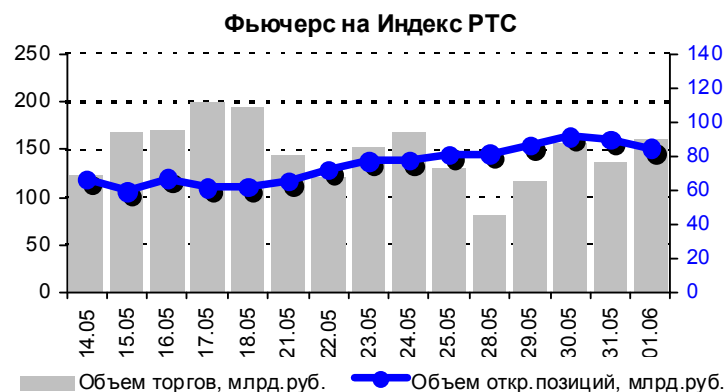
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю потерял в весе 3,54%, при этом июньские и сентябрьские фьючерсы подешевели на 3,63%.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю увеличился на 2,08%.

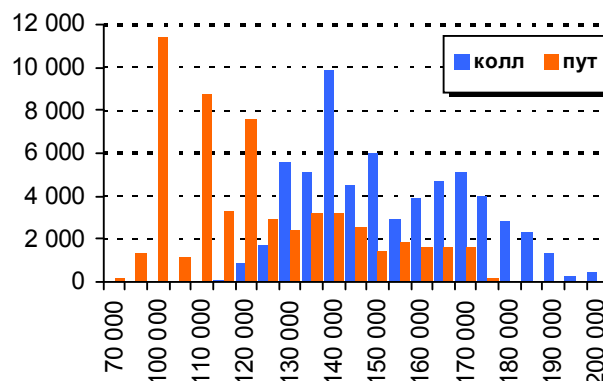
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ, обращающимся в секции FORTS составил на прошедшей неделе 3,50 млрд. рублей или 26,71 тыс. контрактов. За прошедшую неделю было отмечено повышение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ – на 52,96%.

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 54,25 млрд. рублей или 659,72 тыс. контрактов. Объем открытых позиций по состоянию на конец недели составил 127,12 млрд. рублей или 1 399,35 тыс. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 53,52% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 140 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 100 000.

За прошедшую неделю повышение объема открытых позиций по опционам составило 6,69%.



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-06.12 по страйкам, млн.руб.



Индексы ММБФ-РТС – ключевые индикаторы организованного рынка ценных бумаг и производных активов России. Индексы акций относятся к типу взвешенных по капитализации фондовых индексов. В основе их формулы расчета лежит отношение суммарной рыночной капитализации акций, включенных в список индекса, к аналогичному показателю на начальную дату.

Индекс ММБФ представляет собой композитный индекс российского фондового рынка, включающий 30 наиболее ликвидных акций крупнейших и динамично развивающихся российских эмитентов, виды экономической деятельности которых относятся к основным секторам экономики. Расчет индекса осуществляется на основе цен акций, выраженных в рублях Российской Федерации.

Индекс РТС – индикатор широкого рынка, рассчитывается на основании цен 50 ликвидных акций наиболее капитализированных российских эмитентов, что позволяет наиболее точно отражать изменения всего фондового рынка России. Расчет индекса осуществляется на основе цен акций, выраженных в долларах США.

Капитализационные индексы - взвешенные по рыночной капитализации индексы наиболее ликвидных акций российских эмитентов:

MICEX LC (MICEX Large Cap Index) – индекс акций компаний высокой капитализации.

MICEX MC (MICEX Mid Cap Index) – индекс акций компаний стандартной капитализации.

MICEX SC (MICEX Start Cap Index) – индекс акций компаний базовой капитализации.

Отраслевые индексы отражают изменения цен акций, эмитенты которых относятся к соответствующему сектору экономики, представленному на российском фондовом рынке. В их состав входит, как правило, от 10 до 20 ликвидных акций наиболее капитализированных эмитентов данного сектора:

MICEX O&G (RTSog) – индекс акций компаний нефтегазовой отрасли

MICEX PWR (RTSeu) – индекс акций компаний энергетической отрасли

MICEX TLC (RTStl) – индекс акций телекоммуникационных компаний

MICEX M&M (RTSmm) – индекс акций компаний металлургической и горнодобывающей отраслей

MICEX MNF (RTSin) – индекс акций компаний машиностроительной отрасли

MICEX FNL (RTSfn) – индекс акций компаний финансово-банковской отрасли

MICEX CGS (RTScr) – индекс акций компаний потребительского сектора

MICEX CHM – индекс акций компаний химической и нефтехимической отрасли

Производится расчет значений отраслевых индексов, выраженных в рублях, и расчет валютных значений отраслевых индексов, выраженных в долларах США. При этом в качестве «рублевой истории» значений индексов используется «история» значений отраслевых индексов ММБФ, а «валютной истории» – «история» отраслевых индексов РТС.

Региональные индексы – индексы акций, корзины которых включают ценные бумаги, допущенные к торгам в ММБФ-РТС, отобранные по показателям ликвидности и капитализации и ведущих свою деятельность преимущественно в том или ином федеральном округе. На сегодняшний день доступна информация по индексу Сибирского федерального округа – Индексу РТС Сибирь.

Индекс RTS Standard является индикатором рынка наиболее ликвидных акций российских компаний или так называемых «голубых фишек». Индекс рассчитывается на основании цен сделок и котировок 15-ти наиболее ликвидных акций российского фондового рынка. Расчет индекса ведется на основании цен акций, выраженных в рублях.

Индекс ММБФ – инновации – индекс акций российских компаний сектора "Рынок инноваций и инвестиций".

Российский индекс волатильности – индикатор срочного рынка, который рассчитывается на основе волатильности цен опционов на фьючерс на Индекс РТС. При расчете стоимости применяется формула Блэка-Шоулза.

ОАО ММБФ-РТС

Департамент индексов и биржевой информации

Россия, 125009 г. Москва, Большой Кисловский пер., д.13

Телефон: +7(495) 363 -3232 (доб. 24003)

Факс: +7(495) 363 -3232 (доб. 22222)

E-mail: indices@micex.com