

Индекс	Значение 31.05.12	Изменение за период, %		
		месяц	квартал	год
Композитные индексы				
Индекс ММВБ	1 306,42	-11,34%	-18,23%	-21,60%
Индекс РТС	1 242,43	-22,05%	-28,39%	-34,21%
Индекс RTS Standard	9 066,19	-10,12%	-17,24%	-19,63%
Отраслевые индексы (руб.значения)				
Нефть и газ	2 767,94	-11,54%	-17,10%	-10,36%
Электроэнергетика	1 625,61	-21,34%	-32,16%	-39,31%
Потребительский сектор	4 305,28	-12,64%	-13,61%	-19,98%
Телекоммуникации	1 947,61	-10,40%	-16,16%	-19,62%
Машиностроение	1 788,59	-17,06%	-14,34%	-26,78%
Финансы	4 451,87	-12,85%	-20,06%	-27,62%
Химия и нефтехимия	6 942,58	-7,81%	-7,21%	2,51%
Металлы и добыча	2 719,68	-13,38%	-24,89%	-48,53%
Капитализационные индексы				
Высокая кап-я	2 102,42	-10,73%	-17,82%	-21,43%
Стандартная кап-я	2 172,94	-13,17%	-19,29%	-28,14%
Базовая кап-я	3 167,43	-14,72%	-20,10%	-35,56%
Тематические индексы				
Индекс волатильности	46,71	60,68%	42,41%	93,74%
Индекс РТС Сибирь	636,95	-14,20%	-17,39%	-29,66%
Индекс ММВБ Инновации	679,01	-8,85%	-11,12%	-30,58%
Курс доллара (Ц/б РФ)				
USD / RUB	32,45	10,30%	12,09%	15,60%

В мае Индекс ММВБ снизился на 11,34% до 1 306,42 (1 473,50 на 28 апреля 2012г.).

Долларовый Индекс РТС снизился на 22,05% до 1242,43 (1593,97 на 28 апреля 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедший месяц вырос на 10,30%.

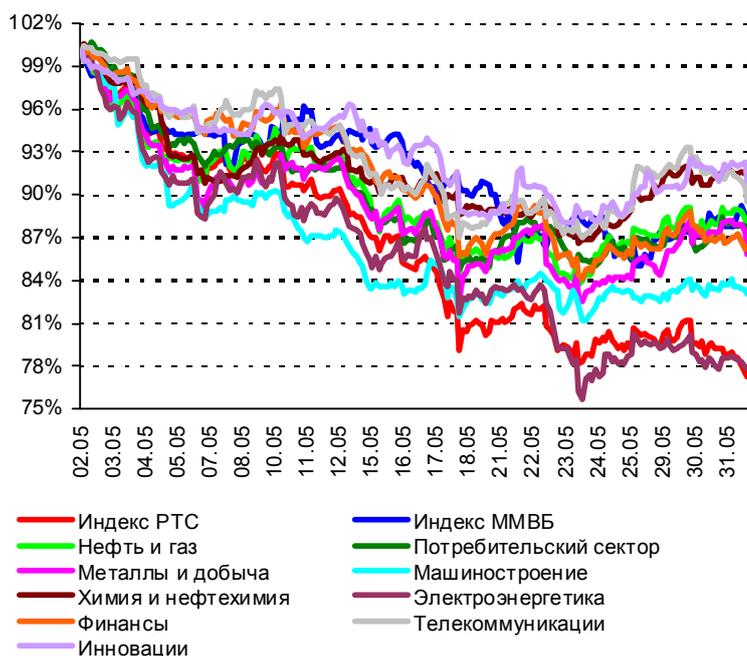
На фондовом рынке наблюдалось повышение волатильности: Российский индекс волатильности повысился на 60,68% до 46,71 пункта (29,07 пункта на 28 апреля 2012г.).

В прошедшем месяце ключевые секторы экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали отрицательную динамику. Лидером снижения стала электроэнергетика: понижение по отраслевому индексу составило 21,34%. Также существенное снижение продемонстрировали сектор машиностроения и металлургии – Индекс машиностроения потерял в весе 17,06%, а Индекс металлов и добычи - 13,38%.

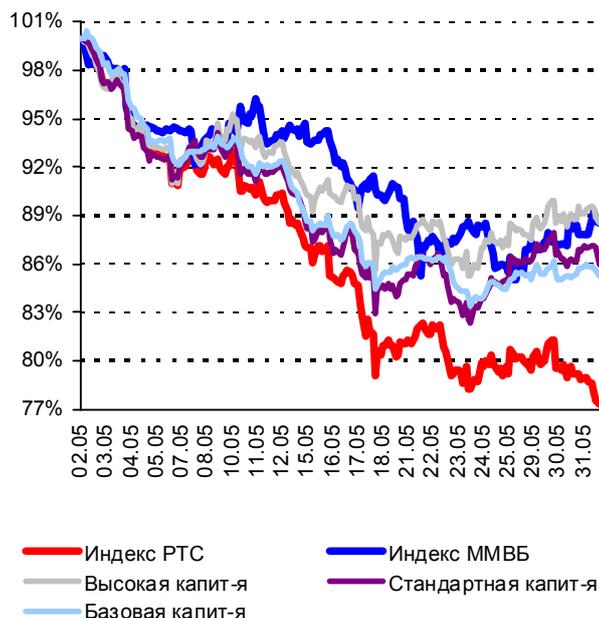
Индекс ММВБ Инновации понизился на 8,85%.

В наибольшей степени снижение рынка акций затронуло небольшие по капитализации компании - индекс компаний базовой капитализации потерял в весе 14,72%, тогда как индексы компаний стандартной и высокой капитализации снизились на 13,17% и 10,73% соответственно.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



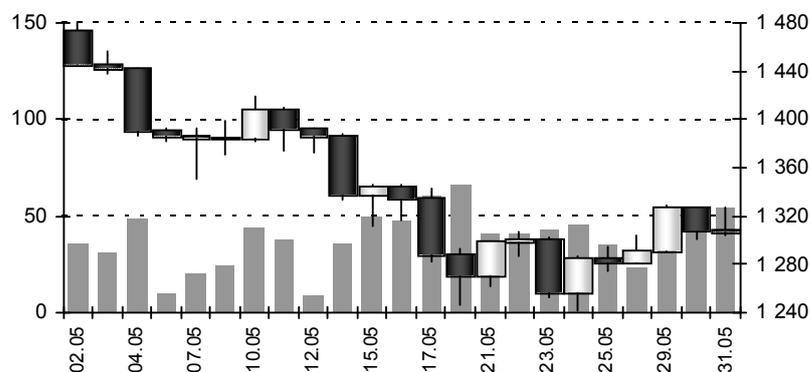
КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ



Индекс ММВБ

Объем торгов (осн)*, млрд.руб.

Индекс ММВБ



* основной рынок

Индекс ММВБ снизился на 11,34% до 1 306,42 (1 473,50 на 28 апреля 2012г.). По состоянию на конец месяца Индекс ММВБ был на 21,60% ниже аналогичного показателя год назад (1 666,30 на 31 мая 2011г.).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил в прошлом месяце 896,14 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец месяца составила 17 541,41 млрд. руб.

По итогам месяца 28 из 30 акций из, входящих список Индекса ММВБ, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-11,61%), 2 ценные бумаги повлияли положительно (+0,27%).

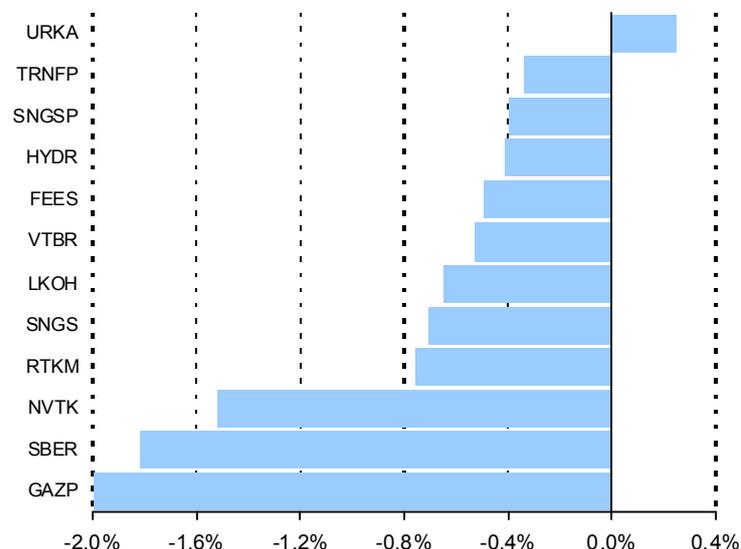
Наибольший вклад в снижение Индекса ММВБ по итогам месяца внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (-5,95%), финансов (-2,48%) и электроэнергетики (-1,34%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало снижение цен на обыкновенные акции ОАО Газпром (-1,99%), ОАО Сбербанк (-1,81%) и ОАО Новатэк (-1,51%).

Наиболее положительно на динамике Индекса ММВБ отразилось повышение цен обыкновенных акций ОАО Уралкалий (+0,25%).

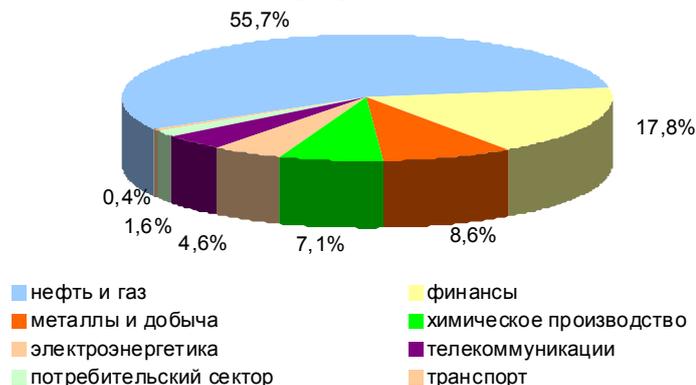
На нефтегазовый сектор приходится 55,7% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 17,8%) и металлургия (8,6%).

Влияние на Индекс ММВБ, %

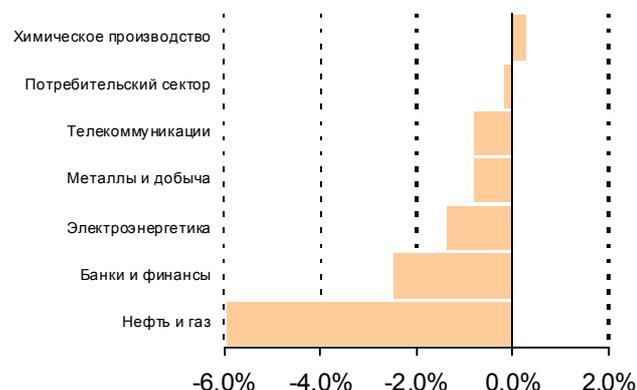


Изменение цены	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	2	28	0	30
Влияние, %	+0,27%	-11,61%	0%	-11,34%

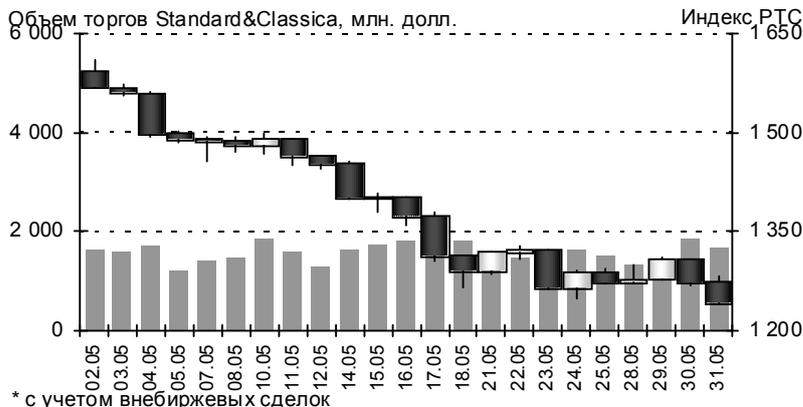
Отраслевая структура Индекса ММВБ



Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %



Индекс РТС



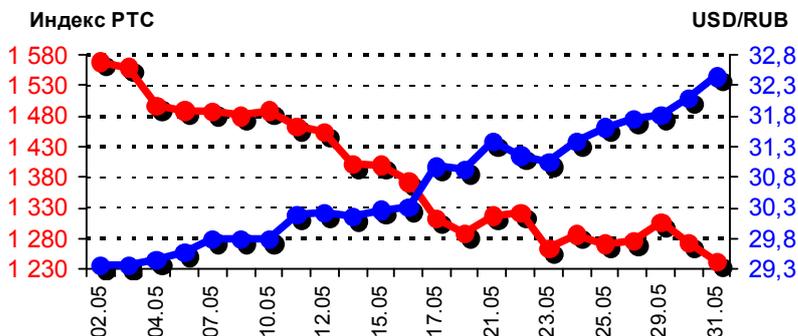
В мае 2012г. Индекс РТС снизился на 22,05% до 1 242,43 (1 593,97 на 28 апреля 2012г.). По состоянию на конец месяца Индекс РТС был на 34,21% ниже аналогичного показателя год назад (1 888,60 на 31 мая 2011г.).

Снижение Индекса РТС в прошедшем месяце сопровождалось повышением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX повысился на 60,68%.

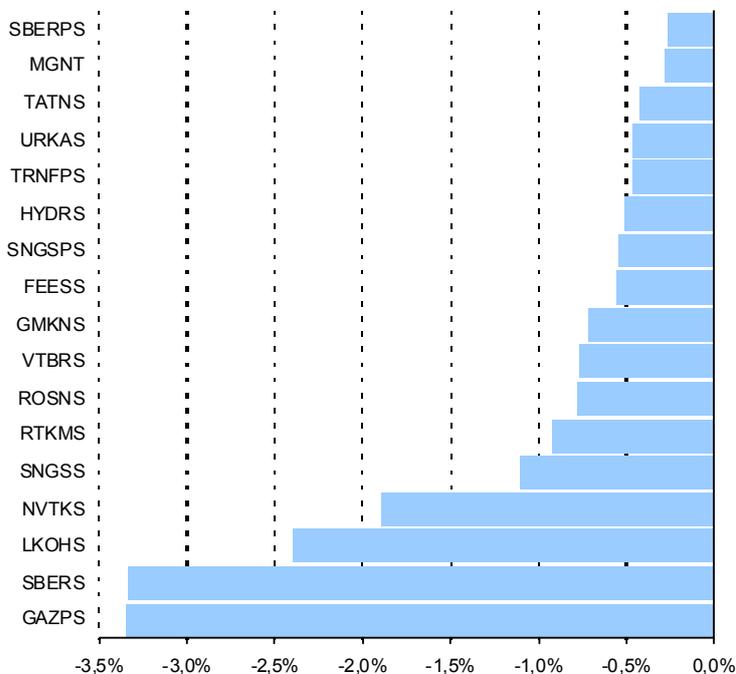
По итогам месяца все 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-22,05%).

Наибольший вклад в снижение Индекса РТС по итогам месяца внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (-11,64%) и финансов (-4,49%).

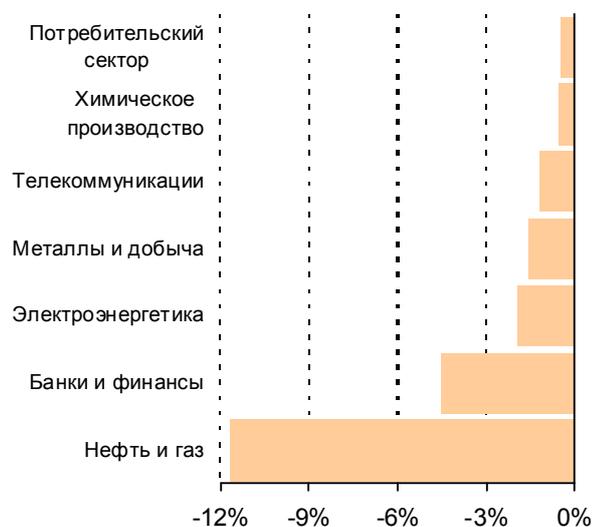
Наибольшее негативное влияние на Индекс РТС оказало снижение цен на обыкновенные акции ОАО Газпром (-3,35%), ОАО Сбербанк (-3,33%) и ОАО Лукойл (-2,40%).



Влияние на Индекс РТС, %

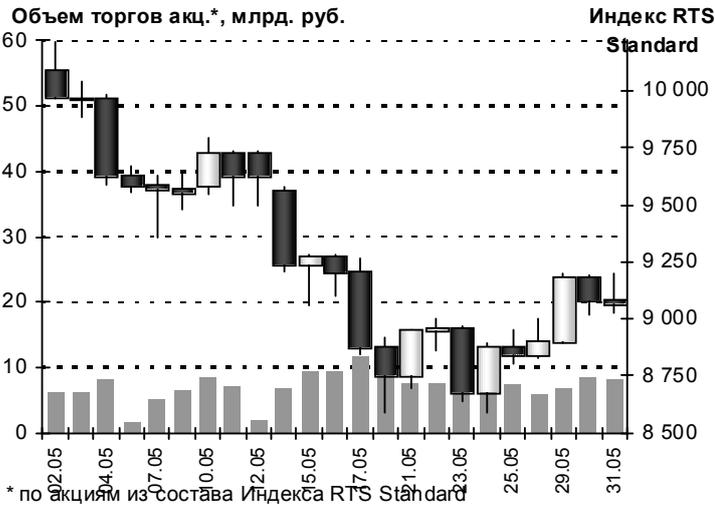


Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %

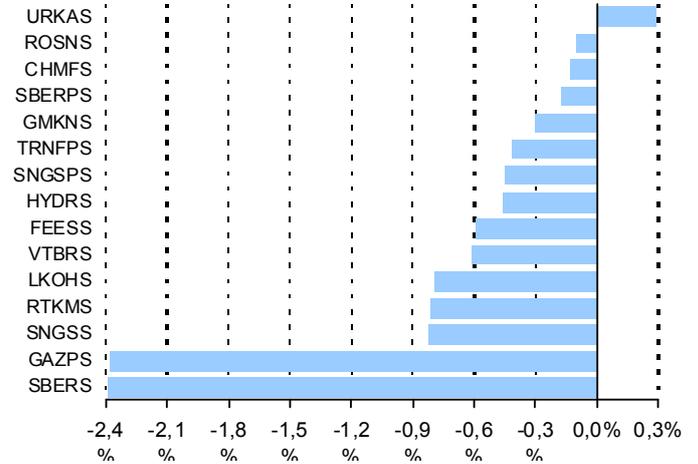


Изменение цены	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	0	50	0	50
Влияние, %	+0%	-22,05%	0%	-22,05%

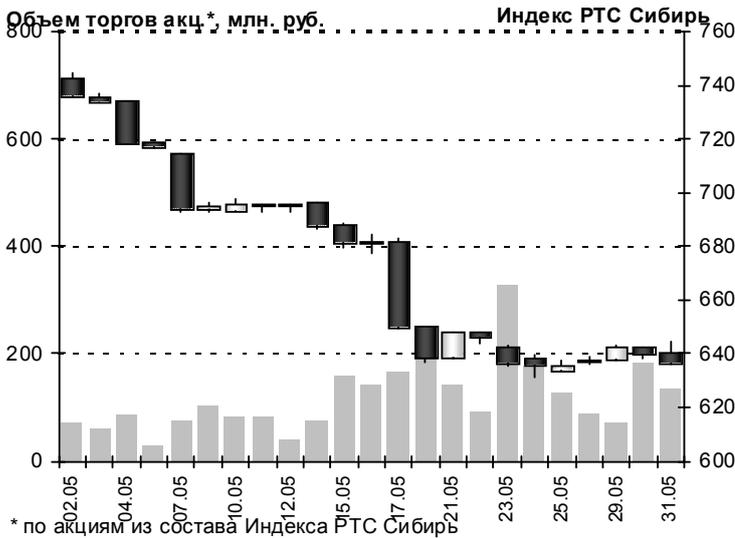
Индекс RTS Standard



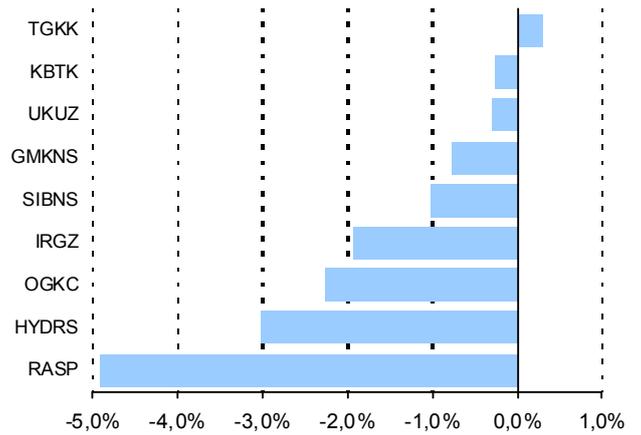
Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %



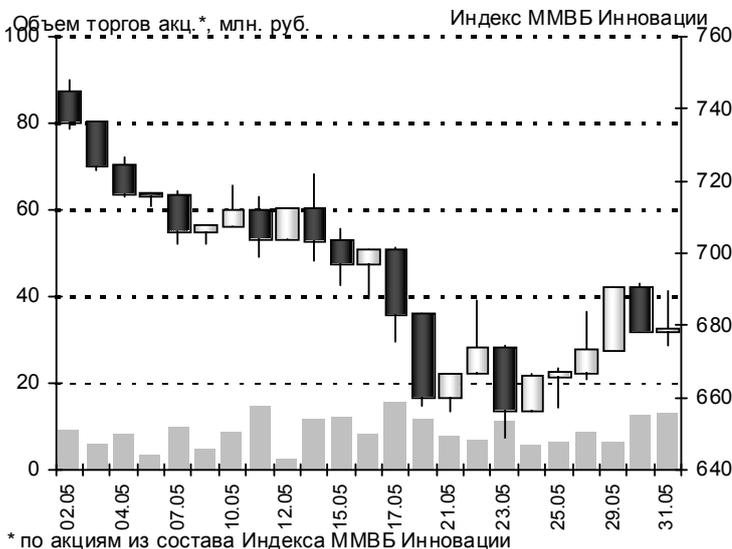
Индекс РТС Сибирь



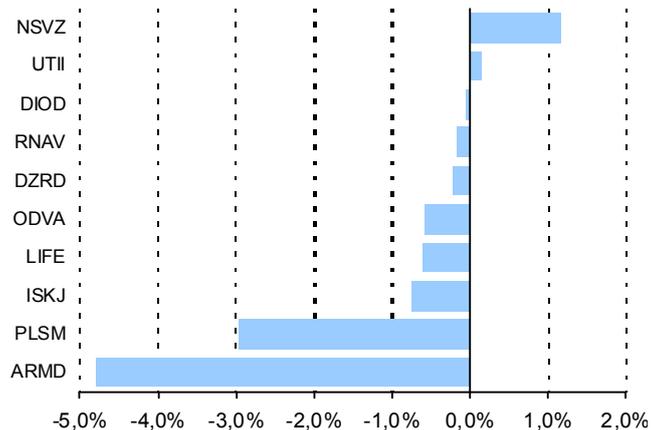
Лидеры влияния на Индекс РТС Сибирь, %



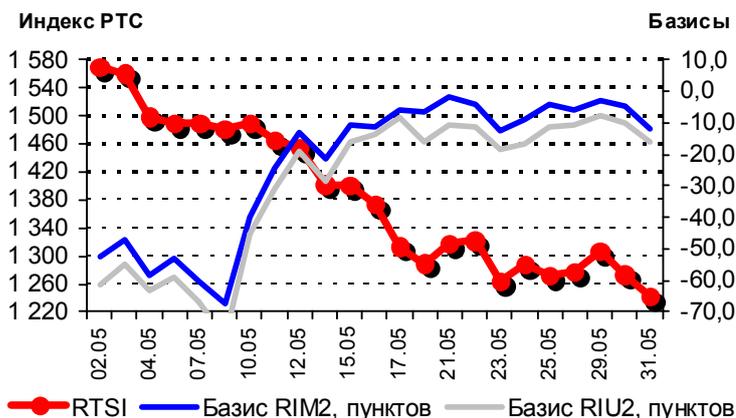
Индекс ММВБ Инновации



Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



Производные на индексы



В мае объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 3 221,12 млрд. рублей или 38,46 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту в прошлом месяце составил 2 909,5 млрд. рублей или 34,8 млн. контрактов.

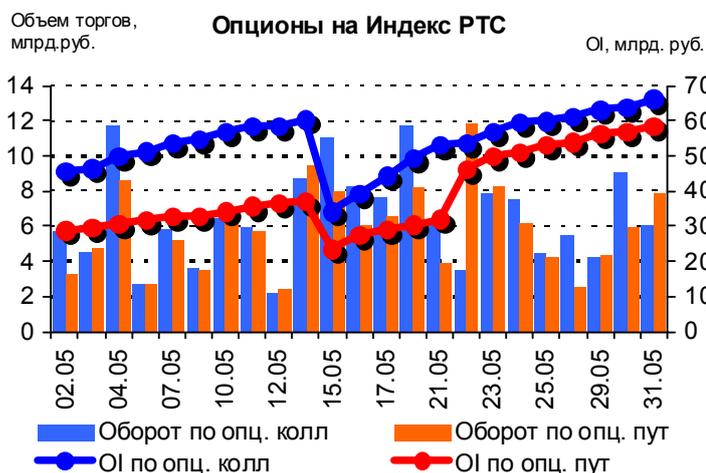
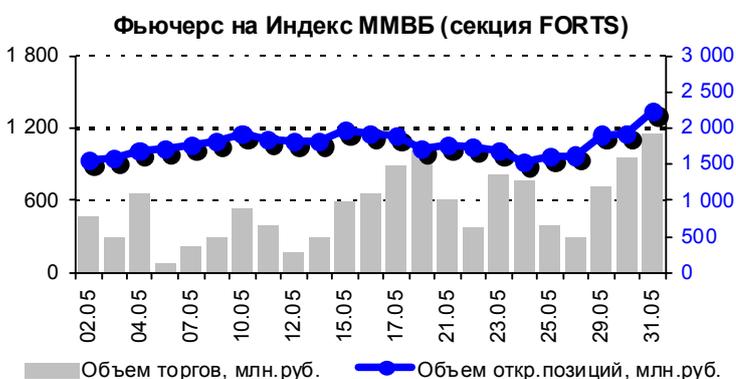
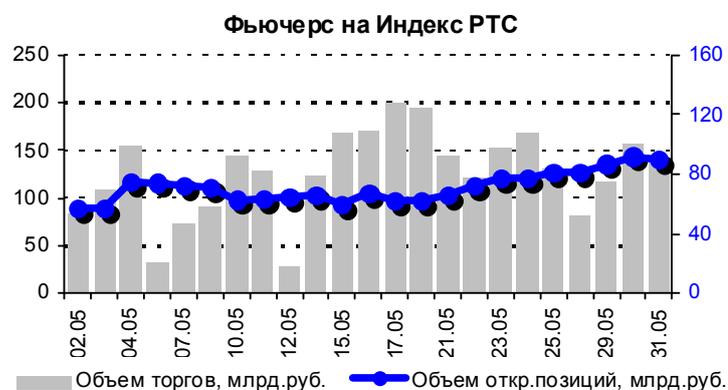
Фьючерсы на Индекс РТС в прошлом месяце торговались в бэжвордации. Индекс РТС за это время потерял в весе 22,05%, при этом июньские фьючерсы подешевели на 20,51%, а сентябрьские подешевели за месяц на 20,40%.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за месяц повысился на 73,51%.

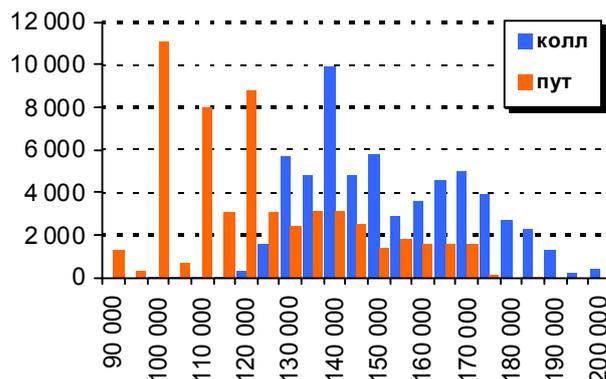
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММБВ, обращающимся в секции FORTS составил в прошедшем месяце 12,61 млрд. рублей или 95,47 тыс. контрактов. За прошедший месяц было отмечено увеличение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММБВ – на 43,14%.

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил в прошлом месяце 287 млрд. рублей или 3,44 млн. контрактов. Объем открытых позиций по состоянию на конец месяца составил 127,12 млрд. рублей или 1 394,72 тыс. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 53,51% 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 прошедший месяц увеличение объема открытых позиций по опционам на фьючерс на Индекс РТС составило 73,19%.



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



Индексы ММВБ-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 ММВБ 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 ММВБ, а «валютной истории» – «история» отраслевых индексов РТС.

Региональные индексы – индексы акций, корзины которых включают ценные бумаги, допущенные к торгам в ММВБ-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 ММВБ – 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 ММВБ-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