

Индекс	Значение 22.06.12	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 347,15	-2,04%	3,54%	-11,92%	-17,86%
Индекс РТС	1 281,88	-4,16%	-3,03%	-22,49%	-31,76%
Индекс RTS Standard	9 295,24	-1,46%	3,71%	-11,08%	-16,67%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	2 850,42	-2,45%	3,95%	-11,69%	-6,12%
Электроэнергетика	1 645,18	-6,14%	-5,40%	-28,96%	-41,10%
Потребительский сектор	4 293,65	-4,75%	-0,91%	-11,15%	-18,90%
Телекоммуникации	1 989,57	-1,71%	1,72%	-14,42%	-18,70%
Машиностроение	1 787,47	-2,37%	-1,48%	-15,60%	-26,89%
Финансы	4 575,94	-1,87%	-0,06%	-14,27%	-21,63%
Химия и нефтехимия	7 062,00	-2,19%	3,93%	-1,57%	2,09%
Металлы и добыча	2 789,97	-3,36%	0,16%	-16,16%	-46,08%
Капитализационные индексы					
Высокая кап-я	2 162,07	-1,55%	2,66%	-11,39%	-17,63%
Стандартная кап-я	2 243,40	-4,67%	2,64%	-14,47%	-24,88%
Базовая кап-я	3 156,72	-1,03%	-1,73%	-18,85%	-35,54%
Тематические индексы					
Индекс волатильности	38,18	-0,78%	-8,75%	14,52%	59,55%
Индекс РТС Сибирь	644,79	-4,66%	-0,27%	-16,39%	-28,31%
Индекс ММВБ Инновации	652,17	-0,37%	-3,26%	-11,12%	-32,34%
Курс доллара (Ц/б РФ)					
USD / RUB	32,91	1,01%	5,61%	12,66%	17,47%

На прошедшей неделе Индекс ММВБ снизился на 2,04% до 1 347,15 (1 375,23 на 15 июня 2012г.).

Долларовый Индекс РТС понизился на 4,16% до 1 281,88 (1 337,50 на 15 июня 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 1,01%.

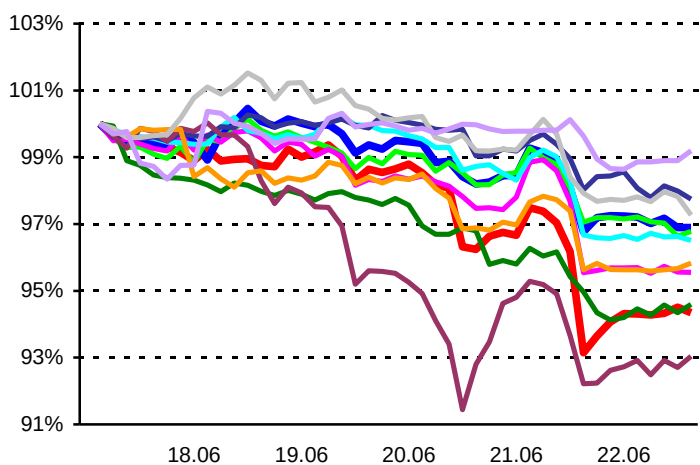
На фондовом рынке наблюдалось понижение волатильности: Российский индекс волатильности опустился на 0,78% до 38,18 пункта (38,48 пункта на 15 июня 2012г.).

На прошедшей неделе все ключевые сектора экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали отрицательную динамику. Лидером падения стала электроэнергетика: понижение по отраслевому индексу составило 6,14%. Также существенное снижение продемонстрировали потребительский сектор и металлургия - Индекс потребительского сектора упал на 4,75%, а Индекс металлов и добычи потерял в весе 3,36%.

Индекс ММВБ Инновации снизился на 0,37%.

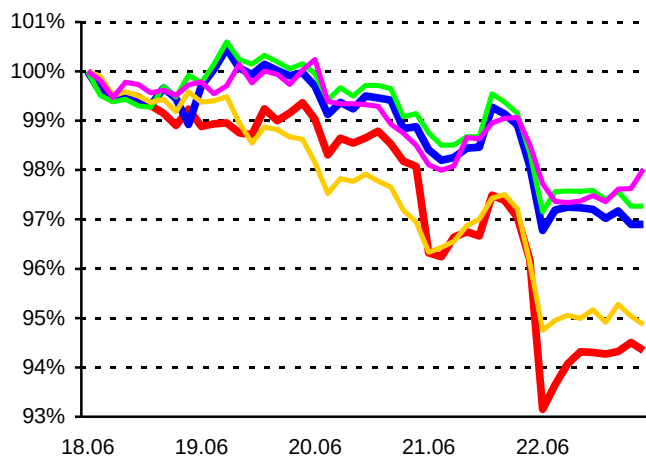
В наибольшей степени падение рынка акций затронуло средние по капитализации компании - Индекс компаний стандартной капитализации потерял в весе 4,67%, тогда как Индексы компаний высокой и базовой капитализации упали на 1,55% и 1,03% соответственно.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



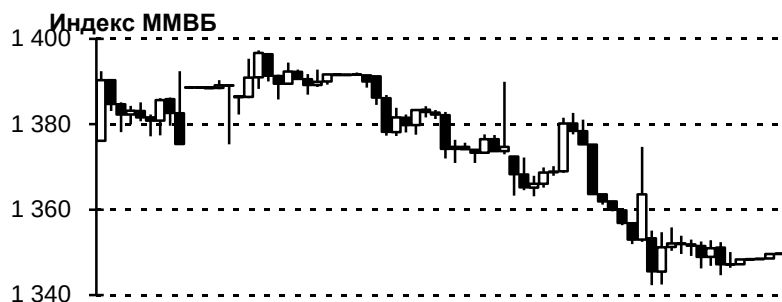
— Индекс РТС
— Нефть и газ
— Металлы и добыча
— Химия и нефтехимия
— Финансы
— Инновации
— Электроэнергетика
— Телекоммуникации

КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ

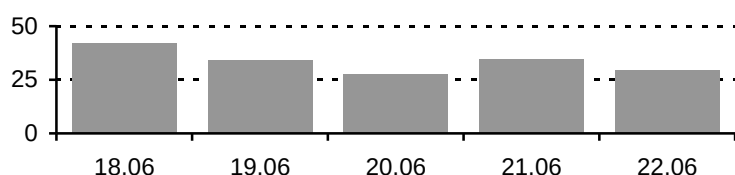


— Индекс РТС
— Высокая капит-я
— Базовая капит-я
— Индекс ММВБ
— Стандартная капит-я

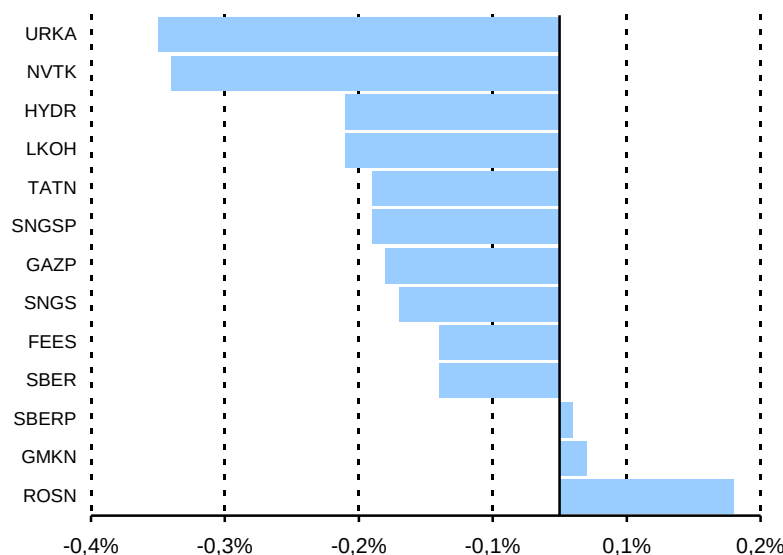
Индекс ММВБ



Объем торгов (осн.), млрд.руб.



Влияние на Индекс ММВБ, %



За неделю с 18 по 22 июня 2012г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику. Индекс ММВБ упал на 2,04% до 1 347,15 (1 375,23 на 15 июня 2012г.). По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 3,54% выше своего закрытия месяц назад (1 301,09 на 22 мая 2012г.) и находился на 17,86% ниже аналогичного показателя год назад (1 640,13 на 22 июня 2011г.).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил 167,98 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец недели составила 18 112,15 млрд. руб.

По итогам недели 27 акций, входящих в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-2,19%), а 3 ценные бумаги повлияли положительно (+0,15%).

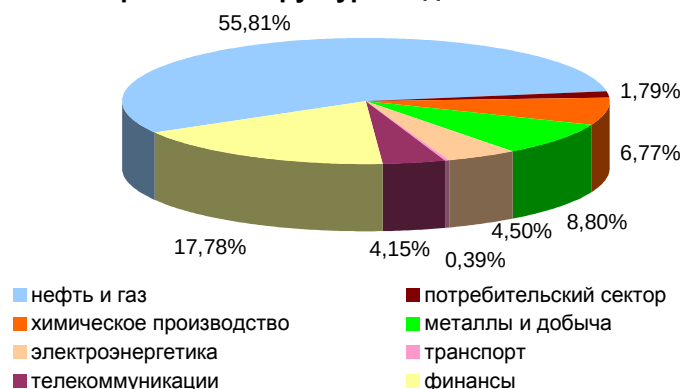
Наибольший вклад в падение Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (-0,95%) и электроэнергетики (-0,40%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало снижение цен на обыкновенные акции ОАО Уралкалий (-0,30%), НОВАТЭК (-0,29%) и ОАО РусГидро (-0,16%).

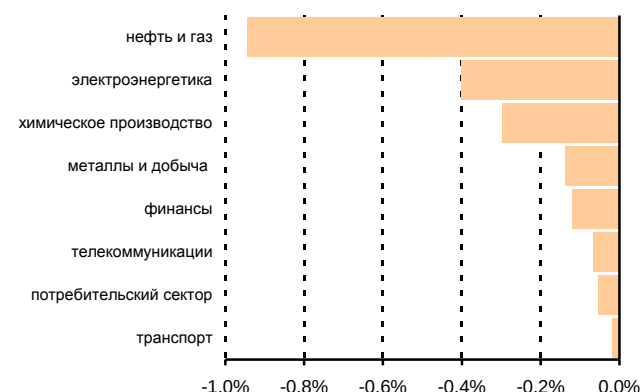
На нефтегазовый сектор приходится 55,81% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 17,78%) и металлургия (8,80%).

Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	3	27	0	30
Влияние, %	+0,15%	-2,19%	0%	-2,04%

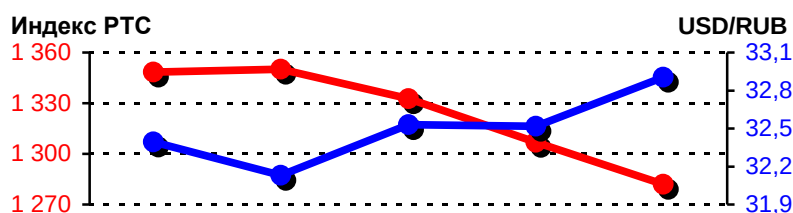
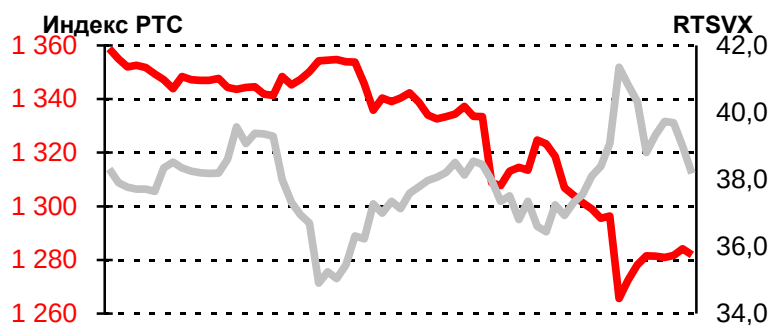
Отраслевая структура Индекса ММВБ



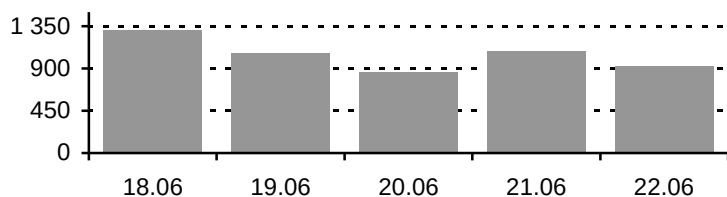
Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %



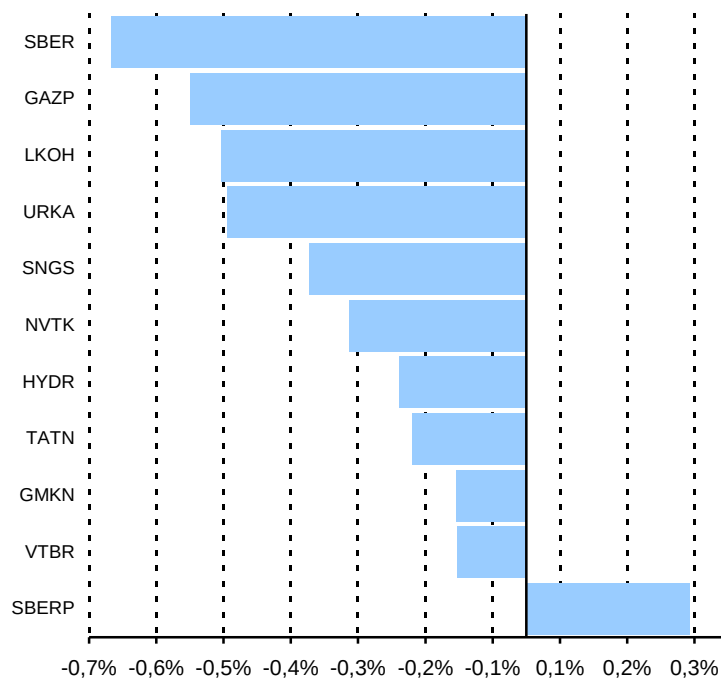
Индекс РТС



Объем торгов (осн.), млн.долл.



Влияние на Индекс РТС, %



Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	2	48	0	50
Влияние, %	+0,24%	-4,40%	0%	-4,16%

За неделю с 18 по 22 июня 2012г. Индекс РТС понизился на 4,16% до 1 281,88 (1 337,50 на 15 июня 2012г.). По состоянию на конец недели Индекс РТС был на 3,03% ниже своего закрытия месяц назад (1 321,87 на 22 мая 2012г.) и находился на 31,76% ниже аналогичного показателя год назад (1 878,38 на 22 июня 2011г.).

Понижение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось снижением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX понизился на 0,78%.

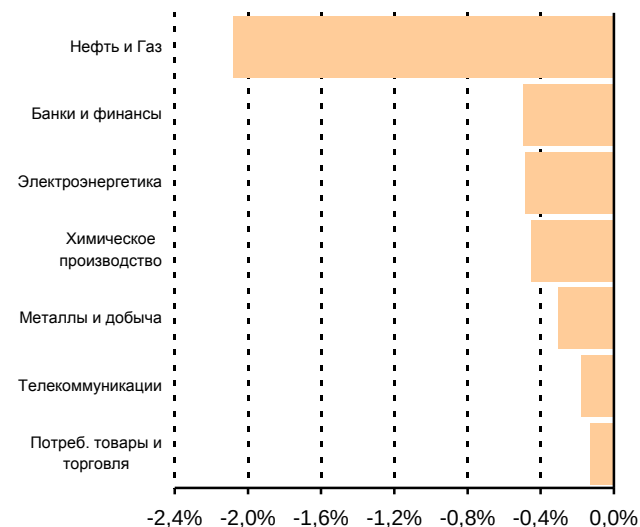
Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 1,01%.

По итогам недели 48 из 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-4,40%), 2 акции – положительное (+0,24%).

Наибольший вклад в падение Индекса РТС по итогам недели внесли ценные бумаги нефти и газа (-2,08%), финансов (-0,49%) и электроэнергетики (-0,48%).

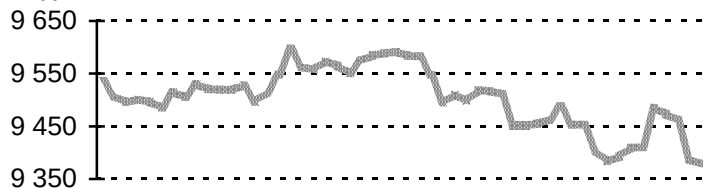
Наибольшее негативное влияние на Индекс РТС оказало снижение цен на обыкновенные акции ОАО Сбербанк России (-0,62%), ОАО Газпром (-0,50%) и ОАО ЛУКОЙЛ (-0,45%).

Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %

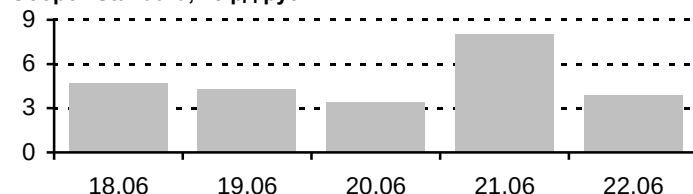


Индекс RTS Standard

Индекс RTS Standard

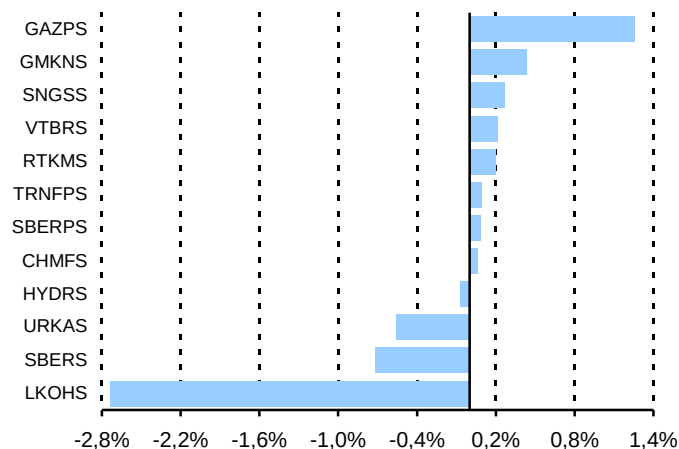


Оборот Standard, млрд.руб.*



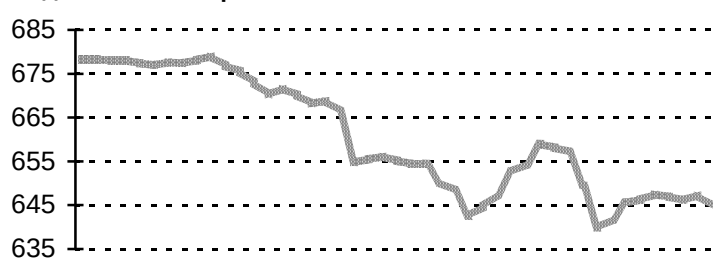
* по акциям из состава Индекса RTS Standard

Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %

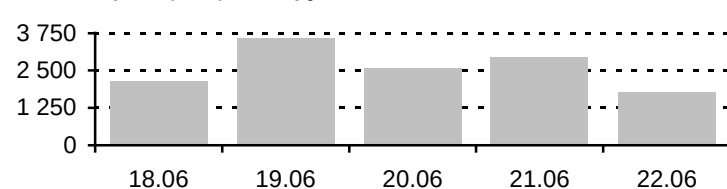


Индекс РТС Сибирь

Индекс РТС Сибирь

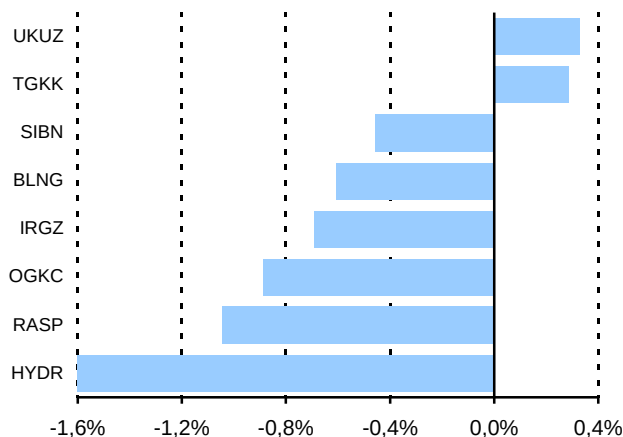


Объем торгов (осн.)*, млн.руб.



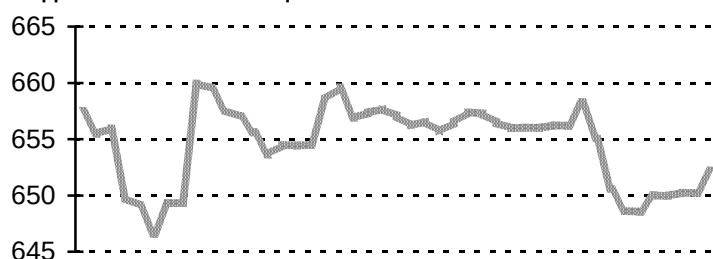
* по акциям из состава Индекса РТС Сибирь

Лидеры влияния на Индекс РТС Сибирь, %

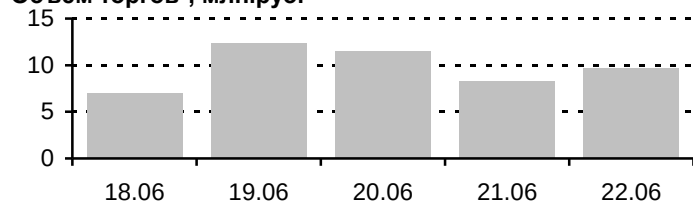


Индекс ММВБ Инновации

Индекс ММВБ Инновации

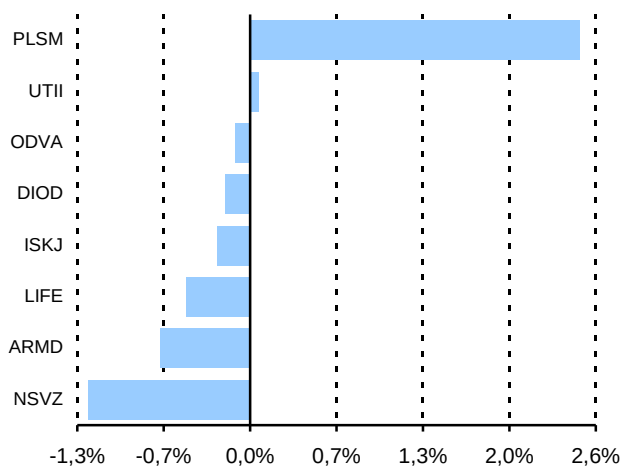


Объем торгов*, млн.руб.

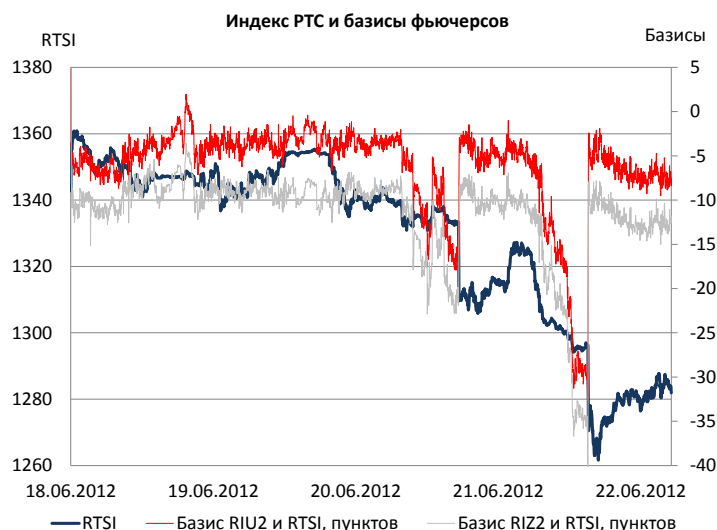


* по акциям из состава Индекса ММВБ инновации

Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



Производные на индексы



За неделю с 18 по 22 июня 2012г. объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 585,25 млрд. рублей или 6,77 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 540,35 млрд. рублей или 6,25 млн. контрактов.

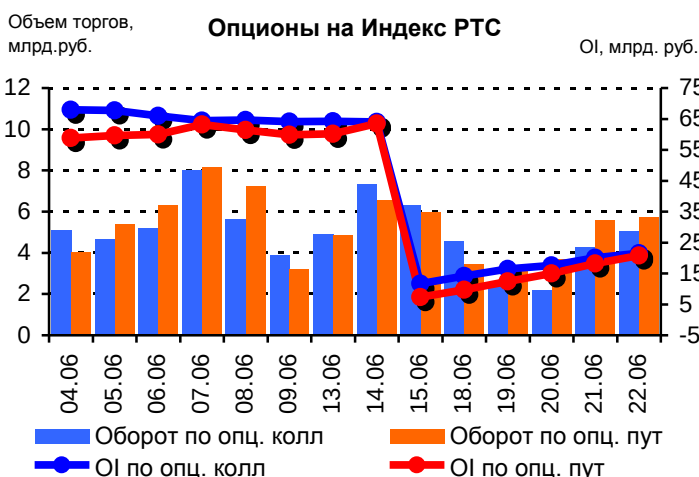
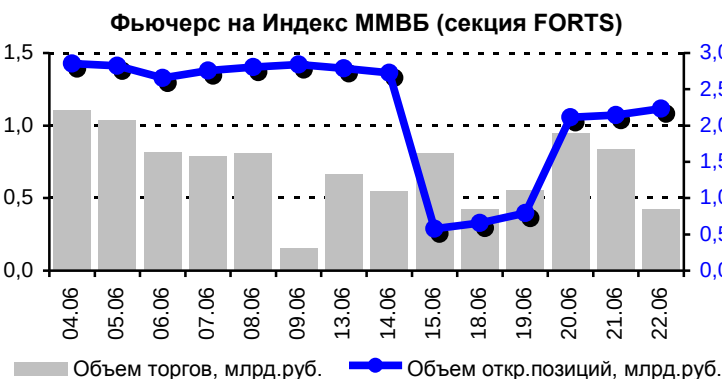
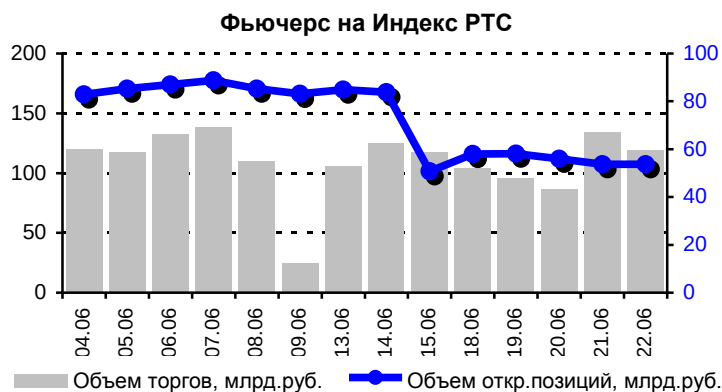
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе преимущественно торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю потерял в весе 4,16%, при этом сентябрьские и декабрьские фьючерсы подешевели на 4,03% и 3,78% соответственно.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю упал на 35,87%

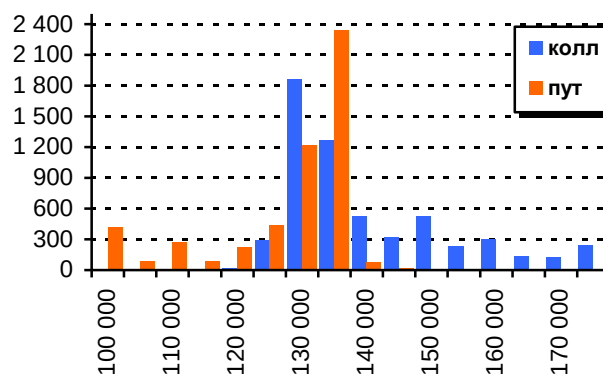
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ, обращающимся в секции FORTS составил на прошедшей неделе 3,19 млрд. рублей или 22,94 тыс. контрактов. За неделю было отмечено уменьшение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ – на 18,99%

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 40,45 млрд. рублей или 476,4 тыс. контрактов. Объем открытых позиций составил 42,39 млрд. рублей или 492,23 тыс. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 49,18% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 130 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 135 000.

За прошедшую неделю понижение объема открытых позиций по опционам на Индекс РТС составило 66,48%.



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-09.12 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

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

Факсы: +7(495) 363 -3232 (доб. 22222)

E-mail: indices@micex.com