

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.

Индекс	Значение 03.05.2013	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 408,03	2,62%	-1,39%	-9,00%	-2,40%
Индекс РТС	1 429,86	3,45%	0,27%	-12,19%	-8,35%
Индекс РТС Стандарт	9 498,95	2,24%	-2,14%	-9,79%	-4,72%
Индекс РТС-2	1 347,40	3,65%	-4,13%	-19,24%	-26,76%
MICEX SC	3 084,90	3,31%	-5,45%	-14,12%	-15,14%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	3 038,81	0,49%	-4,39%	-10,46%	0,15%
Электроэнергетика	1 322,45	11,04%	-6,78%	-27,07%	-33,74%
Потребительский сектор	5 650,73	3,06%	0,56%	1,89%	16,75%
Телекоммуникации	2 111,68	0,38%	-5,39%	-6,68%	-2,50%
Машиностроение	1 749,04	1,24%	-9,73%	-14,62%	-14,89%
Финансы	4 281,71	3,69%	-1,33%	-13,65%	-15,19%
Химия и нефтехимия	7 867,57	0,82%	-2,37%	-6,35%	1,25%
Металлы и добыча	2 308,96	0,40%	-0,90%	-20,85%	-24,52%
Тематические индексы					
Индекс ММВБ-10	3 184,63	2,50%	-2,51%	-11,80%	-5,17%
Индекс Волатильности	18,99	-7,73%	4,46%	-0,37%	-34,79%
Индекс ММВБ Инновации	409,19	1,75%	-3,75%	-15,62%	-43,51%
Индекс РТС Сибирь	512,25	1,24%	-7,21%	-22,75%	-30,21%
Курс доллара (ЦБ РФ)					
USD / RUB	31,04	-0,87%	-0,24%	3,42%	5,69%

За неделю с 29 апреля по 3 мая 2013г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ повысился на 2,62% до 1 408,03 пунктов (1 372,04 пунктов на 26 апреля 2013г.), долларовой Индекс РТС вырос на 3,45% до 1 429,86 пунктов (1 382,22 пунктов на 26 апреля 2013г.).

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю упал на 0,87%.

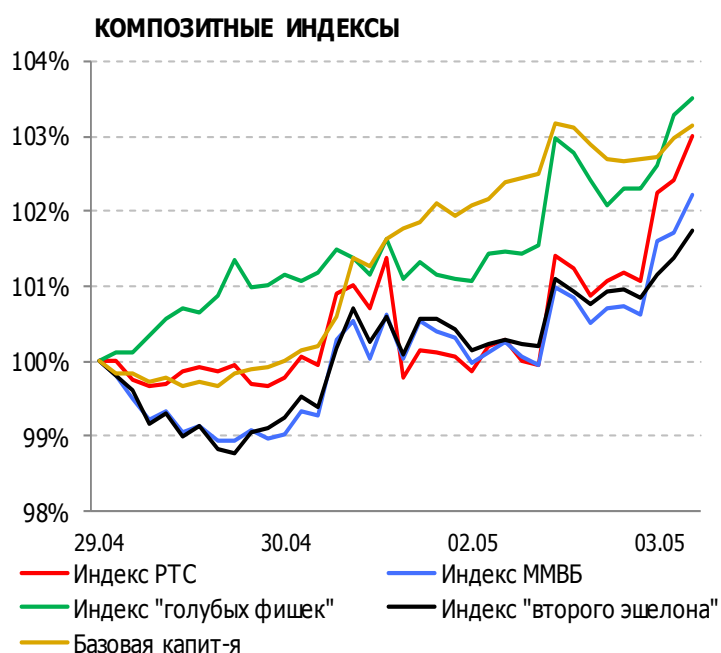
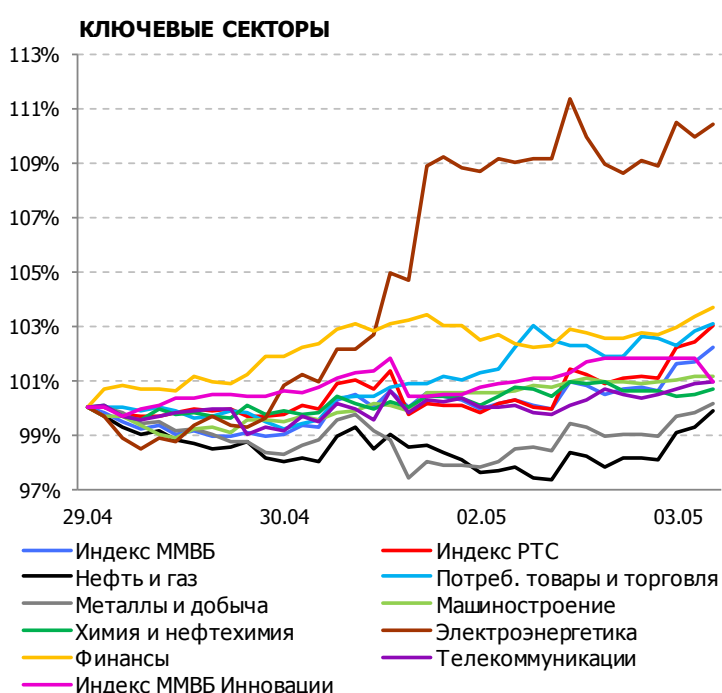
На фондовом рынке наблюдалось понижение волатильности: Российский индекс волатильности понизился на 7,73% до 18,99 пункта (20,58 пункта на 26 апреля 2013г.).

На прошедшей неделе все ключевые секторы экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали положительную динамику. Лидером роста стала электроэнергетика: повышение по отраслевому индексу составило 11,04%. Также существенное увеличение продемонстрировали финансовый и потребительский секторы – Индекс финансов вырос на 3,69%, а Индекс потребительского сектора прибавил в весе 3,06%.

Индекс ММВБ Инновации повысился на 1,75% до 409,19 пунктов (402,16 пунктов на 26 апреля 2013г.).

Индекс голубых фишек РТС Стандарт вырос на 2,24% до 9 498,95 пунктов (9 290,47 пунктов на 26 апреля 2013г.).

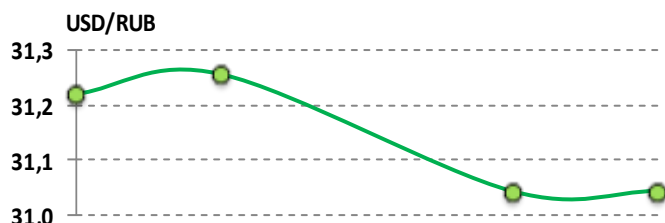
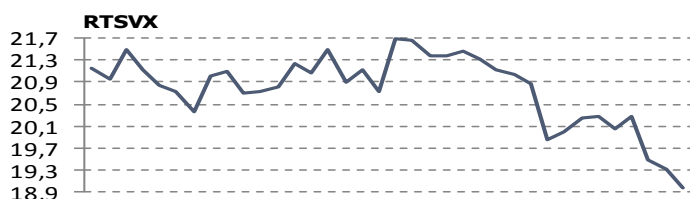
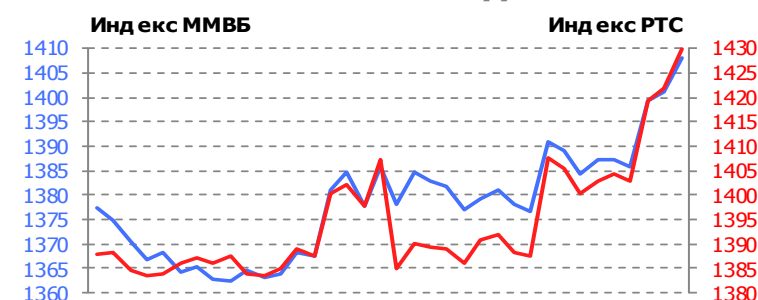
Индексы «второго эшелона» продемонстрировали положительную динамику. Рублевый Индекс MICEX SC вырос на 3,31% до 3 084,90 пунктов (2 985,96 пунктов на 26 апреля 2013г.). Долларовый Индекс РТС-2 прибавил в весе 3,65% и составил 1 347,40 пунктов (1 299,94 пунктов на 26 апреля 2013г.).



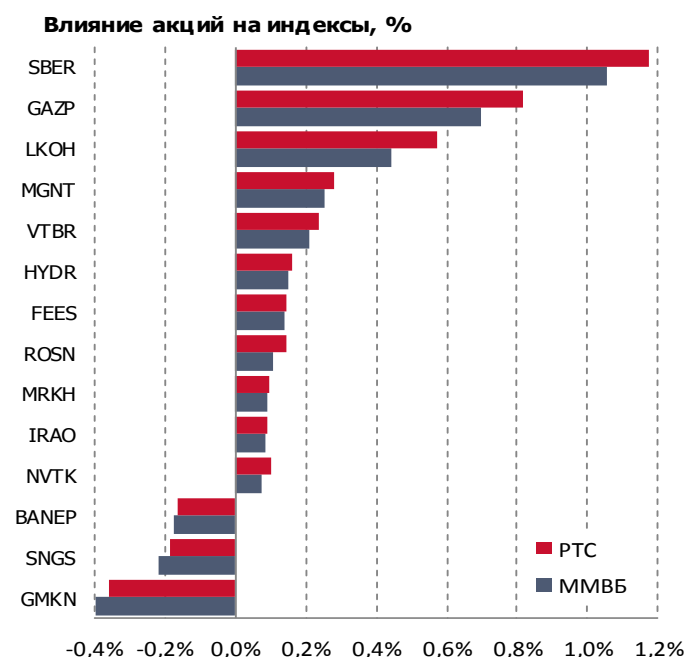
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.

Основные индексы Московской Биржи – ММВБ и РТС



*по акциям, входящим в базу расчета индексов ММВБ и РТС



За неделю с 29 апреля по 3 мая 2013г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ повысился на 2,62% до 1 408,03 пунктов (1 372,04 пунктов на 26 апреля 2013г.), долларовый Индекс РТС вырос на 3,45% до 1 429,86 пунктов (1 382,22 пунктов на 26 апреля 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 1,39% ниже своего закрытия месяц назад (1 427,94 пунктов на 3 апреля 2013г.) и находился на 2,40% ниже аналогичного показателя год назад (1 442,71 пунктов на 3 мая 2012г.). Индекс РТС был на 0,27% выше своего закрытия месяц назад (1 425,99 пунктов на 3 апреля 2013г.) и находился на 8,35% ниже аналогичного показателя год назад (1 560,11 пунктов на 3 мая 2012г.).

Повышение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось понижением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX понизился на 7,73%.

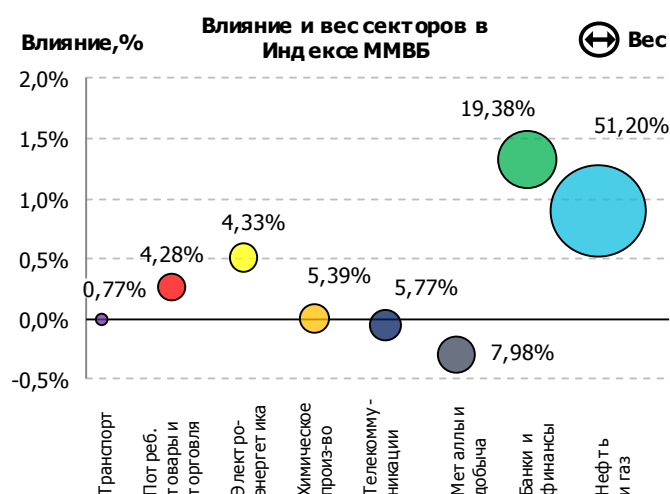
Наибольшее позитивное влияние на Индекс ММВБ оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО Сбербанк России (+1,05%), ОАО Газпром (+0,70%) и ОАО ЛУКОЙЛ (+0,44%).

Объем торгов ценными бумагами, включенными в базу расчета индексов Московской Биржи, составил 101,50 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в состав индексов, на конец недели составила 19 210,04 млрд. руб.

По итогам недели 36 акций, входящих в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику положительное воздействие (+3,62%), 14 ценных бумаг повлияли отрицательно (-1,00%).

Наибольший вклад в рост Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги финансов (+1,32%) и нефти и газа (+0,90%).

На нефтегазовый сектор приходится 51,20% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 19,38%) и металлургия (7,98%).



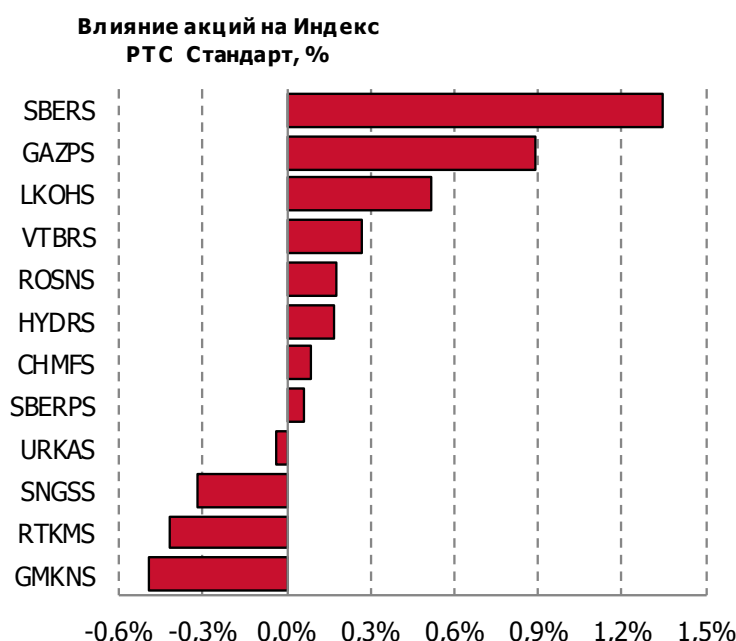
Влияние на индексы за неделю	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс ММВБ	+3,62%	-1,00%	+2,62%
Индекс РТС	+4,31%	-0,86%	+3,45%

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

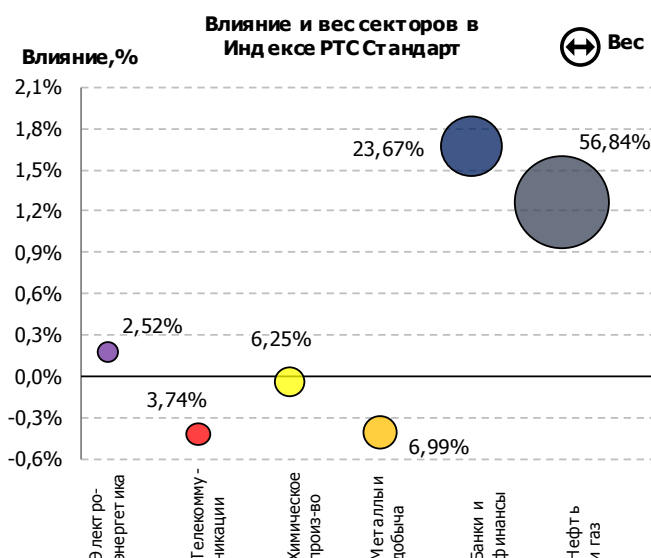
неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.
Индекс «голубых фишек»



*по акциям из состава индекса РТС Стандарт



Изменение цены за неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние
Количество	8	6	1	15
Влияние, %	+3,51%	-1,27%	0%	+2,24%



За неделю с 29 апреля по 3 мая 2013г. рублевый Индекс «голубых фишек» РТС Стандарт продемонстрировал положительную динамику.

Индекс РТС Стандарт повысился на 2,24% до 9 498,95 пунктов (9 290,47 пунктов на 26 апреля 2013г.). По состоянию на конец недели Индекс РТС Стандарт был на 2,14% ниже своего закрытия месяц назад (9 706,99 пунктов на 3 апреля 2013г.) и находился на 4,72% ниже аналогичного показателя год назад (9 969,67 пунктов на 3 мая 2012г.).

По итогам недели 8 из 15 ценных бумаг, входящих в список индекса «голубых фишек», оказали на его динамику положительное воздействие (+3,51%), 4 акции повлияли отрицательно (-1,27%), цена 3 ценных бумаг не изменилась.

Наиболее позитивно на динамике Индекса РТС Стандарт отразилось рост цен обыкновенных акций ОАО Сбербанк России, влияние которых составило +1,34% и ОАО Газпром (+0,89%).

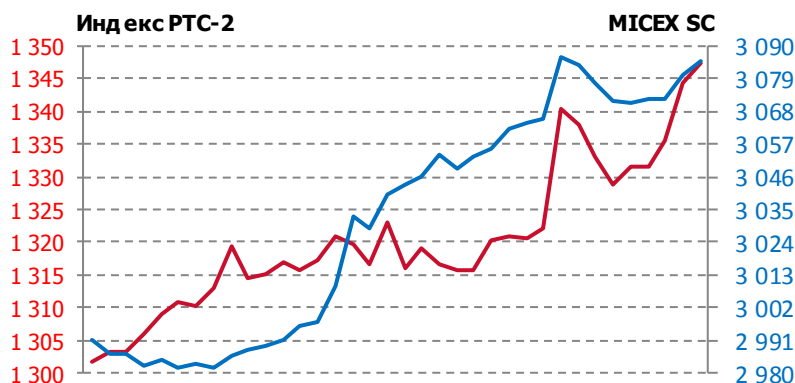
Наиболее негативное влияние на динамику Индекса РТС Стандарт оказали обыкновенные акции ОАО ГК Норильский Никель (-0,49%) и ОАО Ростелеком (-0,42%).

На нефтегазовый сектор приходится 56,84% суммарной капитализации индекса «голубых фишек». Среди остальных отраслей выделяются финансовый сектор (вес в индексе 23,67%) и металлургия (6,99%).

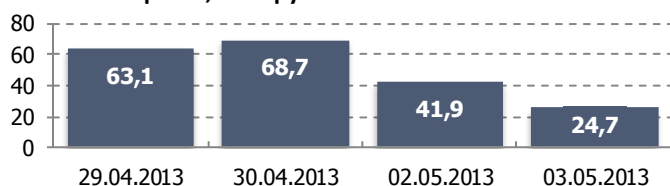
Код	Наименование	Вес в индексе РТС Стандарт	Вес в индексе ММВБ
CHMF	Северсталь, ао	1,35%	1,06%
FEES	ФСК ЕЭС, ао	0,79%	0,77%
GAZP	Газпром, ао	19,08%	14,86%
GMKN	ГМК Норильский никель, ао	5,64%	4,40%
HYDR	РусГидро, ао	1,73%	1,35%
LKOH	ЛУКОЙЛ, ао	19,89%	15,51%
NVTK	НОВАТЭК, ао	4,60%	3,58%
ROSNS	НК Роснефть, ао	5,75%	4,46%
RTKM	Ростелеком, ао	3,74%	3,20%
SBER	Сбербанк России, ао	18,82%	14,67%
SBERP	Сбербанк России, ап	1,30%	1,00%
SNGSS	Сургутнефтегаз, ао	4,83%	1,92%
TRNF	АК Транснефть, ап	2,70%	2,11%
URKA	Уралкалий, ао	6,25%	4,90%
VTBR	Банк ВТБ, ао	3,55%	2,77%
Всего		100,00%	76,55%

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.
Индекс «второго эшелона»

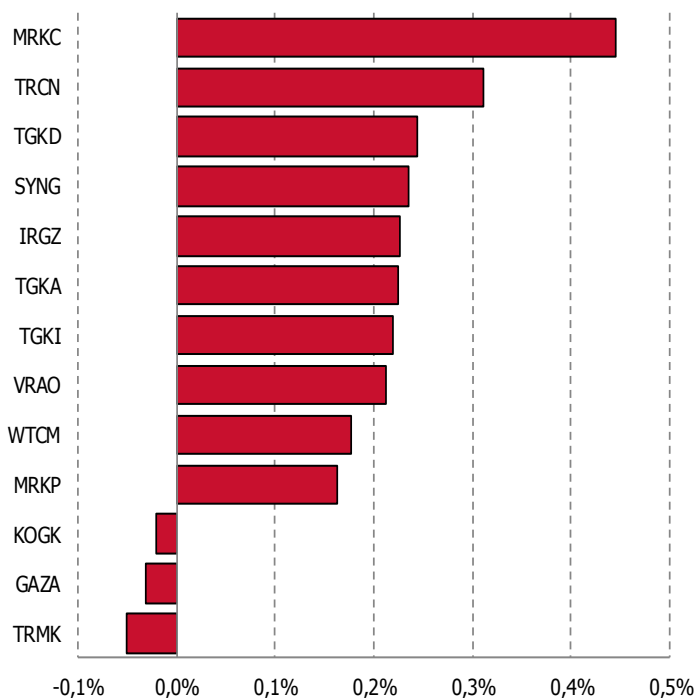


Объем торгов*, млн.руб.



*по акциям из состава индекса PTC-2

Влияние акций на Индекс PTC-2, %



Изменение цены за неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние
Количество бумаг	40	8	2	50
Влияние, %	+3,78%	-0,13%	0%	+3,65%

За неделю с 29 апреля по 3 мая 2013г. Индексы «второго эшелона» продемонстрировали положительную динамику. Рублевый Индекс MICEX SC вырос на 3,31% до 3 084,90 пунктов (2 985,96 пунктов на 26 апреля 2013г.). Долларовый Индекс PTC-2 прибавил в весе 3,65% и составил 1 347,40 пунктов (1 299,94 пунктов на 26 апреля 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс MICEX SC был на 5,45% ниже своего закрытия месяц назад (3 262,57 пунктов на 3 апреля 2013г.) и находился на 15,14% ниже аналогичного показателя год назад (3 635,21 пунктов на 3 мая 2012г.).

Индекс PTC-2 был на 4,13% ниже своего закрытия месяц назад (1 405,46 пунктов на 3 апреля 2013г.) и находился на 26,76% ниже аналогичного показателя год назад (1 839,65 пунктов на 3 мая 2012г.).

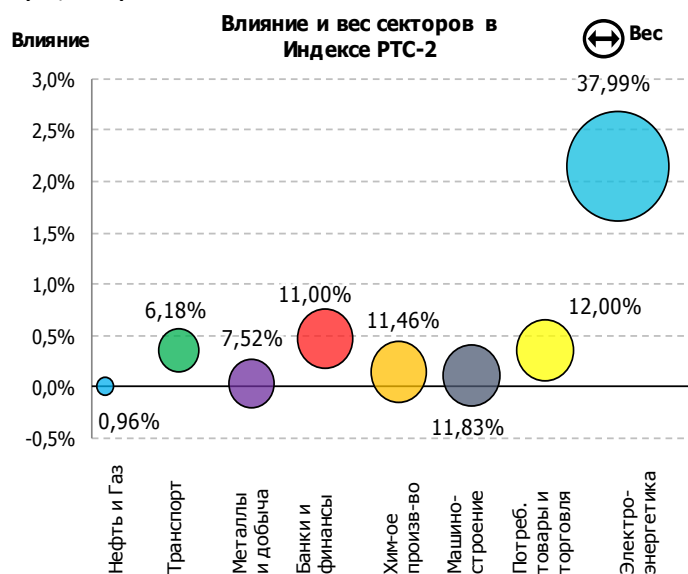
По итогам недели 40 ценных бумаг, входящих в список Индекса PTC-2, оказали на его динамику положительное воздействие (+3,78%), 8 акций повлияли отрицательно (-0,13%), цена 2 ценных бумаг не изменилась.

Наиболее позитивно на динамике Индекса PTC-2 отразилось повышение цен обыкновенных акций ОАО МРСК Центра (+0,45%) и ОАО ТрансКонтейнер (+0,31%).

Наибольшее негативное влияние на динамику Индекса PTC-2 оказали обыкновенные акции ОАО ТМК (-0,05%) и ОАО ГАЗ (-0,03%).

Наибольший вклад в рост индекса «второго эшелона» по итогам недели внесли ценные бумаги электроэнергетики (+2,16%) и финансов (+0,47%).

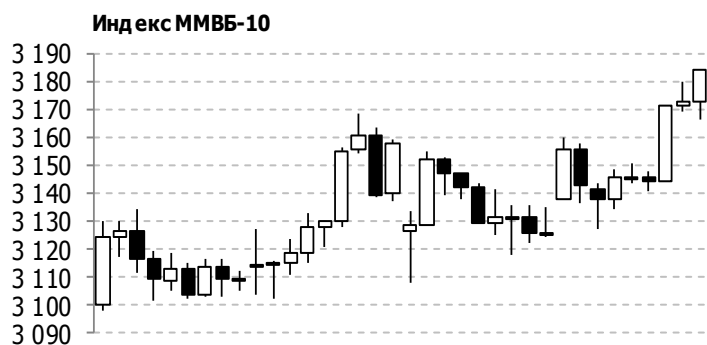
На электроэнергетику приходится 37,99% суммарной капитализации Индекса PTC-2. Среди остальных отраслей выделяются потребительский сектор (вес в индексе 12,00%) и машиностроение (11,83%).



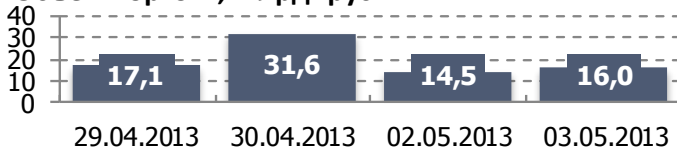
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.

Индекс ММВБ-10

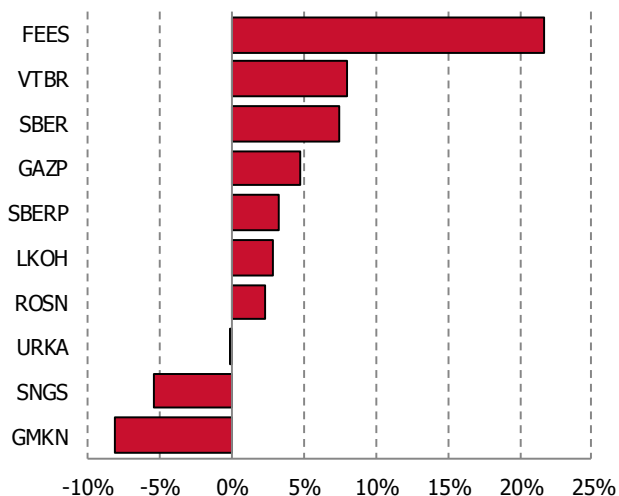


Объем торгов*, млрд. руб.



*по акциям из состава индекса ММВБ-10

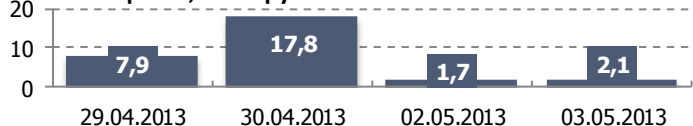
Приrost цен акций в Индексе ММВБ-10, %



Индекс ММВБ Инновации

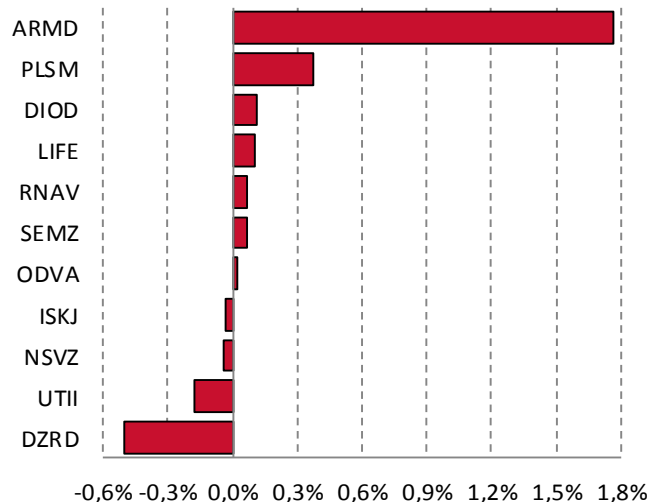


Объем торгов*, млн. руб.

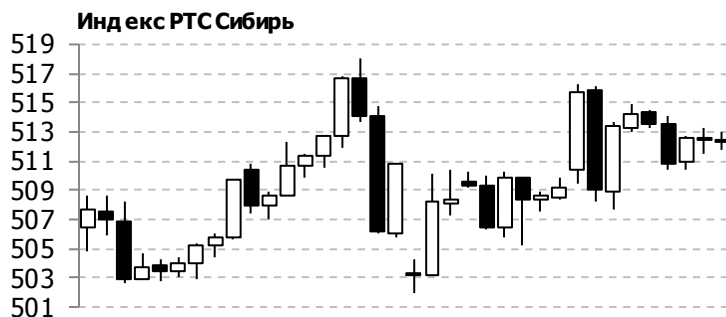


*по акциям из состава индекса ММВБ Инновации

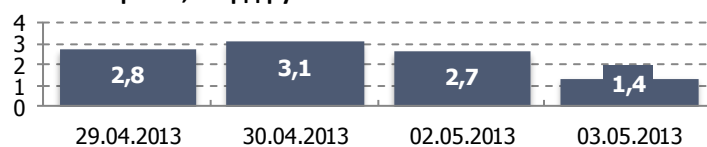
Влияние акций на индекс ММВБ Инновации, %



Индекс РТС Сибирь

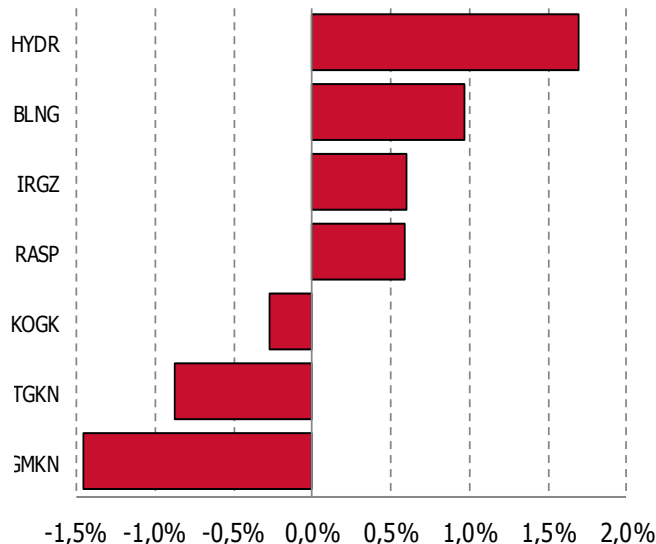


Объем торгов*, млрд. руб.



*по акциям из состава индекса РТС Сибирь

Влияние акций на Индекс РТС Сибирь, %



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.

Долговой рынок

Индекс	Значение	Изменение за период			
	03.05.2013	неделя	месяц	квартал	год
Индексы государственных облигаций					
RGBI	141,65	0,68%	1,78%	2,97%	7,66%
RGBI-tr	328,66	0,80%	3,56%	3,51%	15,44%
Доходность (бп)	6,24	-19	-17	-64	-117
Индексы корпоративных облигаций					
MICEXCBICP	93,63	0,02%	0,25%	0,13%	0,71%
MICEXCBITR	232,17	0,15%	0,88%	2,15%	8,89%
Доходность (бп)	7,77	6	5	-20	-76
Индексы муниципальных облигаций					
MICEXMBICP	97,6	0,02%	0,20%	0,20%	0,80%
MICEXMBITR	171,69	0,12%	0,83%	0,83%	8,18%
Доходность (бп)	7,77	5	5	-8	-28
Индексы активов пенсионных накоплений					
Консервативный	1549,79	0,15%	13,96%	13,28%	7,90%
Сбалансированный	1365,63	0,79%	-10,20%	-4,92%	4,92%
Агрессивный	1183,76	1,62%	-0,14%	-2,67%	-9,05%
Индикаторы ставок РЕПО по акциям					
Овернайт	5,78	49	20	12	43
1 неделя	5,08	65	119	-22	141
2 недели	6,85	-31	90	-5	-107
Индикаторы ставок РЕПО по облигациям					
Овернайт	6,43	-8	-39	-44	-6
1 неделя	4	183	212	301	236
2 недели	6,53	-19	5	-69	15

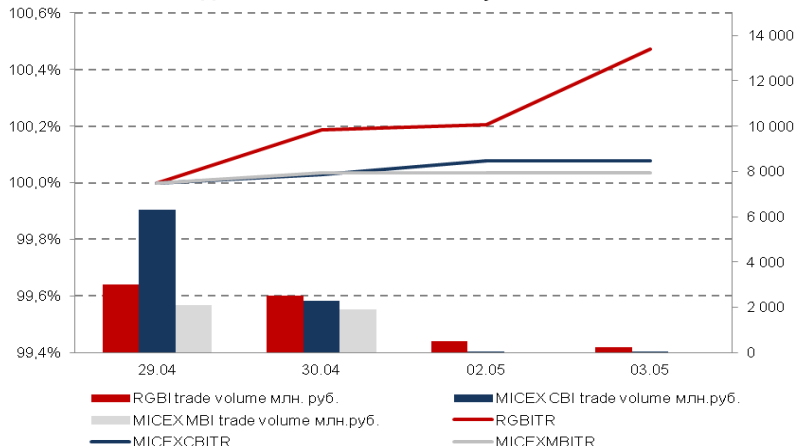
На прошедшей неделе ценовой Индекс государственных облигаций России (RGBI) вырос на 0,68% до 141,65 пункта (140,70 на 26 апреля 2013 г.). При этом средневзвешенная доходность облигаций, входящих в базу расчета индекса, снизилась на 19 базисных пунктов и составила 6,24%.

Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI TR (совокупный доход) показал положительную динамику и составил 171,69 пунктов, рост на 0,12% (171,49 на 26 апреля 2013 г.).

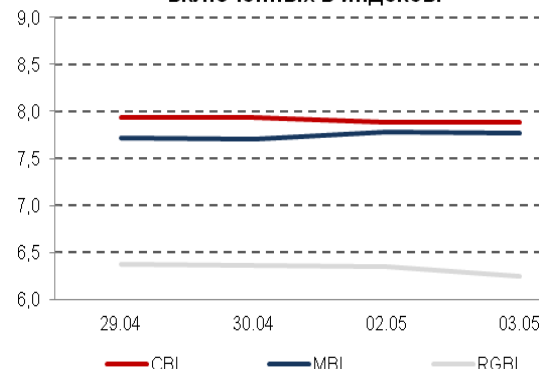
В секторе корпоративных облигаций индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, MICEX CBI TR вырос на 0,15% и составил 232,17 пункта.

Консервативная стратегия вложения средств по индексу пенсионных накоплений обеспечила бы рост на уровне 0,15% за неделю, агрессивная стратегия – на 1,62% за неделю.

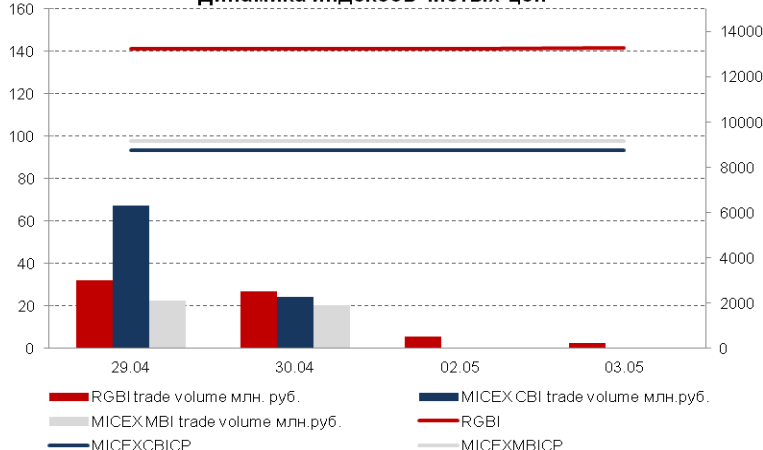
Динамика индексов совокупных цен



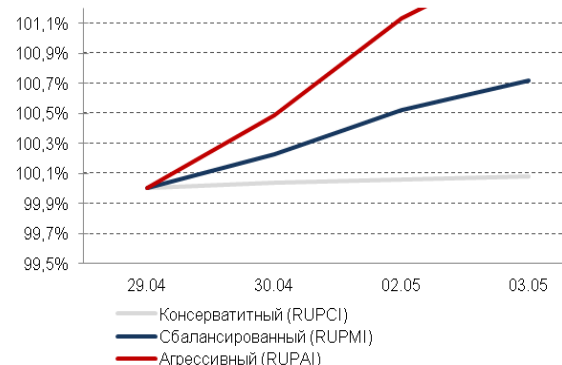
Доходность к погашению облигаций, включенных в индексы



Динамика индексов чистых цен



Динамика индексов активов пенсионных накоплений



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 апреля по 3 мая 2013г.

Производные на индексы



За неделю с 29 апреля по 3 мая 2013г. объем торгов производными инструментами на индексы на Московской Бирже составил 372,13 млрд. рублей или 4,40 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 314,00 млрд. рублей или 3,71 млн. контрактов.

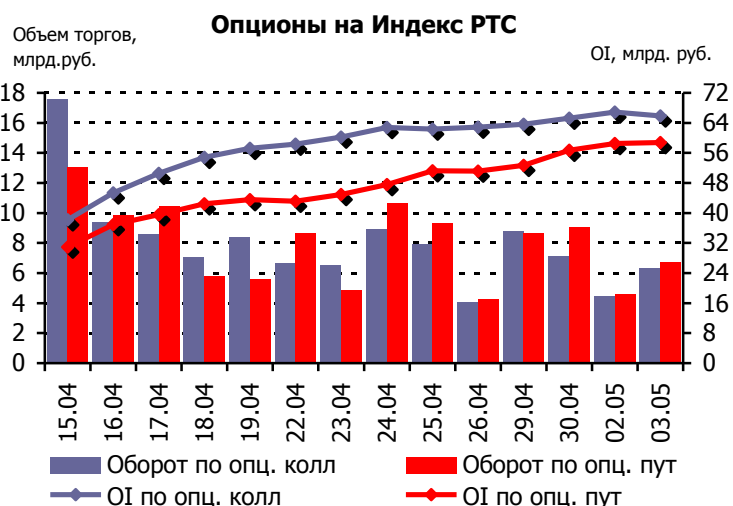
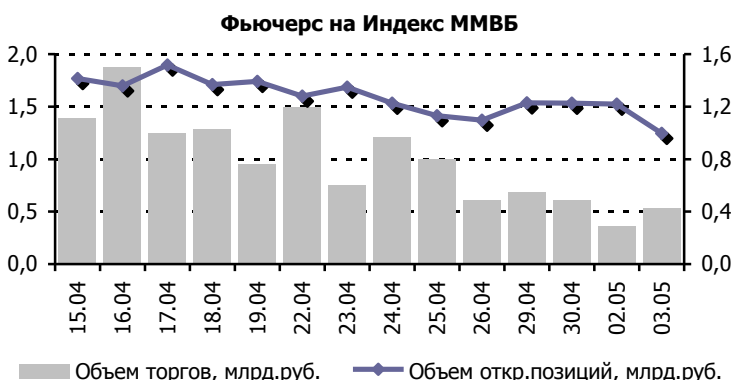
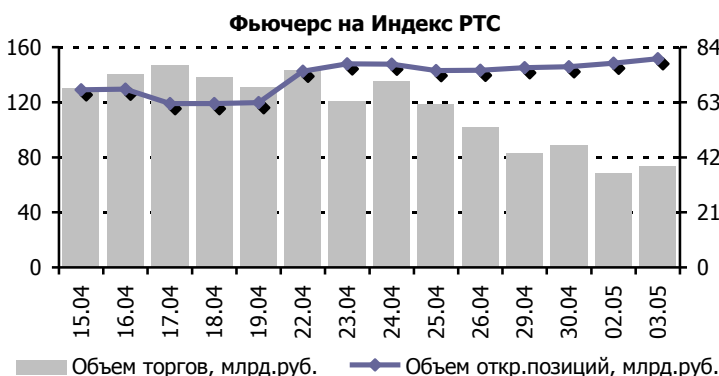
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе преимущественно торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю прибавил в весе 3,45%, при этом июньские и сентябрьские фьючерсы подорожали на 4,27% и на 4,32% соответственно.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю вырос на 2,31%

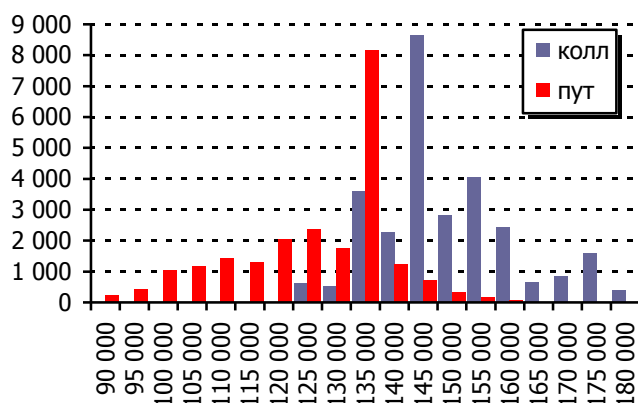
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ составил на прошедшей неделе 2,19 млрд. рублей или 16,08 тыс. контрактов. За неделю было отмечено уменьшение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ на 12,11%

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 55,72 млрд. рублей или 668,82 тыс. контрактов. Объем открытых позиций составил 124,64 млрд. рублей или 1,48 млн. контрактов. При этом на долю опционов пут приходилось 47,14% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 145 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 135 000.

За прошедшую неделю повышение объема открытых позиций по опционам на Индекс РТС составило 10,06%.



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-6.13 по страйкам, млн.руб.



Индексы Московской Биржи – ключевые индикаторы организованного рынка ценных бумаг и производных инструментов 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 и Индекс РТС представляют собой композитные индексы российского фондового рынка, включающие 50 наиболее ликвидных акций крупнейших и динамично развивающихся российских эмитентов. Расчет Индекса ММВБ осуществляется на основе цен акций, выраженных в рублях Российской Федерации, а расчет Индекса РТС – на основе цен акций, выраженных в долларах США.

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

Расчет значений отраслевых индексов производится в рублях и в долларах США. При этом в качестве «рублевой истории» значений индексов используется «история» значений отраслевых индексов ММВБ, а «валютной истории» – «история» отраслевых индексов РТС.

Индекс «голубых фишек» (РТС Стандарт) 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 "голубых фишек" ММВБ10 – представляет собой ценовой, невзвешенный индекс, рассчитываемый как среднее арифметическое изменения цен 10 наиболее ликвидных акций, допущенных к обращению на бирже. Индекс отражает прирост стоимости портфеля, состоящего из 10 акций, веса которых в составе портфеля в начальный момент времени одинаковы.

Индекс «второго эшелона» (РТС-2) – это индикатор, который характеризует динамику цен акций эмитентов со средним и начальным уровнем капитализации. В состав индекса входят 50 акций, следующих в рейтинге по капитализации с учетом free-float после базы расчета основных индексов – Индекса ММВБ и Индекса РТС. Индекс рассчитывается на основе цен акций, выраженных в долларах США.

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

Региональные индексы – индексы акций, корзины которых включают ценные бумаги, допущенные к торгам на Московской Бирже, 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.

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.

Облигационные индексы - семейство облигационных индексов включает Индекс корпоративных облигаций MICEX CBI, Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI и Индекс государственных облигаций RGBI, отражающие ситуацию в различных сегментах российского облигационного рынка. Облигационные индексы рассчитываются одновременно по трем методикам: «total return», «clean price» и «gross price». Для баз расчета облигационных индексов осуществляется также расчет показателей дюраций и доходности к погашению.

Индикаторы ставок РЕПО - расчетные показатели, отражающие конъюнктуру российского биржевого рынка РЕПО. Расчет индикаторов ставки РЕПО осуществляется отдельно для рынка РЕПО с акциями и рынка РЕПО с облигациями. В расчет принимаются сделки, совершаемые с акциями, включенными в базу расчета Индекса ММВБ, а также сделки с облигациями, включенными в ломбардный список Банка России. В зависимости от сроков исполнения сделок РЕПО, используемых для расчета, индикаторы делятся на однодневные индикаторы "overnight", индикаторы "1 неделя" и "2 недели".

Московская Биржа 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