

Индекс	Значение 31.05.2013	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 350,17	-2,22%	-2,58%	-9,14%	3,35%
Индекс РТС	1 331,43	-4,11%	-5,39%	-13,23%	7,16%
Индекс голубых фишек	9 148,54	-2,23%	-2,59%	-9,58%	0,91%
Индекс второго эшелона	3 027,00	-1,31%	-0,43%	-15,67%	-4,43%
Индекс широкого рынка	956,34	-2,19%	-2,62%	-9,21%	2,54%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	2 944,58	-2,45%	-2,26%	-9,11%	6,38%
Электроэнергетика	1 204,45	-5,09%	-4,17%	-28,20%	-25,91%
Потребительский сектор	5 672,37	-1,19%	2,66%	-0,02%	31,75%
Телекоммуникации	2 000,86	-2,38%	-4,90%	-12,37%	2,73%
Машиностроение	1 689,41	-0,79%	-2,41%	-20,02%	-5,55%
Финансы	4 353,39	-0,92%	2,31%	-10,08%	-2,21%
Химия и нефтехимия	7 867,57	0,20%	-0,15%	-6,83%	8,23%
Металлы и добыча	2 131,07	-1,16%	-6,50%	-20,73%	-21,64%
Тематические индексы					
Индекс ММВБ-10	3 014,73	-2,62%	-4,54%	-11,67%	-3,19%
Индекс Волатильности	25,20	2,86%	21,50%	16,61%	-46,05%
Индекс ММВБ Инновации	413,02	3,16%	0,91%	-10,57%	-39,17%
Индекс РТС Сибирь	461,06	-2,91%	-9,75%	-26,53%	-27,61%
Курс доллара (ЦБ РФ)					
USD / RUB	31,59	0,38%	1,07%	3,16%	-2,66%

За неделю с 27 по 31 мая 2013г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ понизился на 2,22% до 1 350,17 пунктов (1 380,88 пунктов на 24 мая 2013г.), долларовой Индекс РТС упал на 4,11% до 1 331,43 пунктов (1 388,52 пунктов на 24 мая 2013г.).

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 0,38%.

На фондовом рынке наблюдалось повышение волатильности: Российский индекс волатильности повысился на 2,86% до 25,20 пункта (24,50 пункта на 24 мая 2013г.).

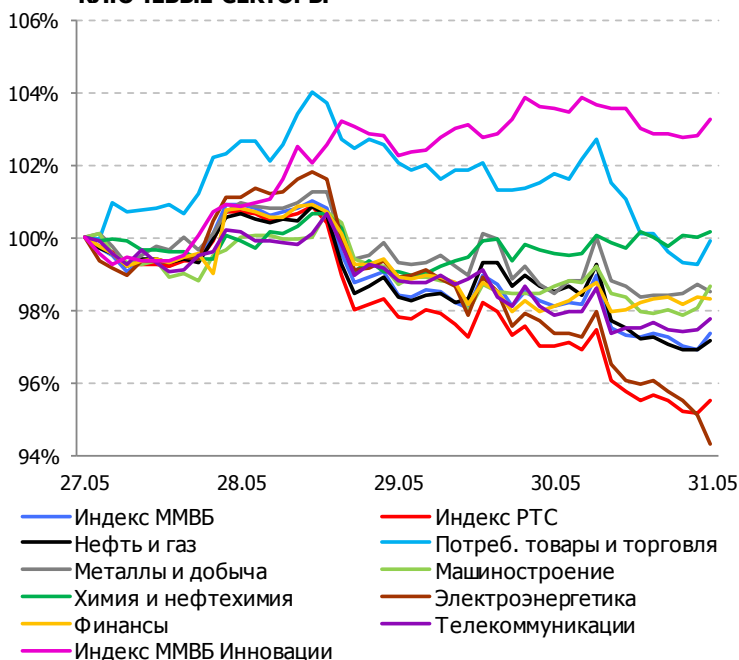
На прошедшей неделе большинство ключевых секторов экономики, представленных на российском фондовом рынке, показали отрицательную динамику. Лидером падения стала электроэнергетика: понижение по отраслевому индексу составило 5,09%. Также существенное снижение продемонстрировали нефтегазовый и телекоммуникационный секторы – Индекс нефти и газа упал на 2,45%, а Индекс телекоммуникаций потерял в весе 2,38%. Рост был отмечен в нефтехимическом секторе – Индекс химии и нефтехимии повысился на 0,20%.

Индекс ММВБ Инновации повысился на 3,16% до 413,02 пунктов (400,38 пунктов на 24 мая 2013г.).

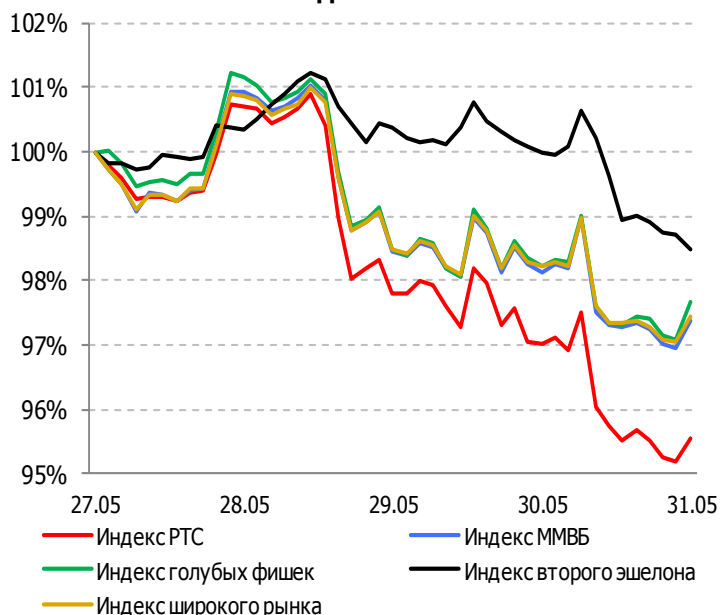
Индекс голубых фишек упал на 2,23% до 9 148,54 пунктов (9 357,66 пунктов на 24 мая 2013г.).

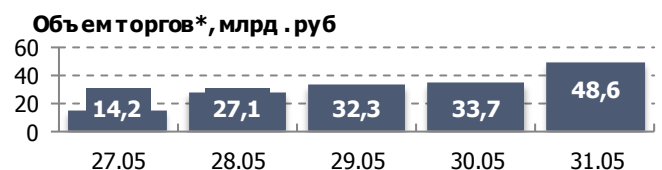
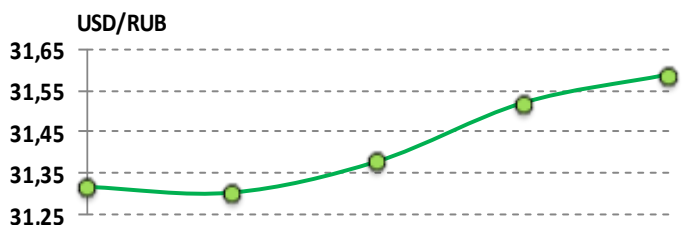
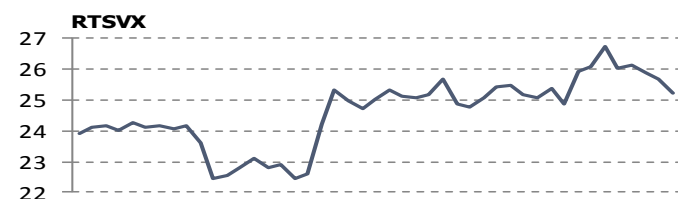
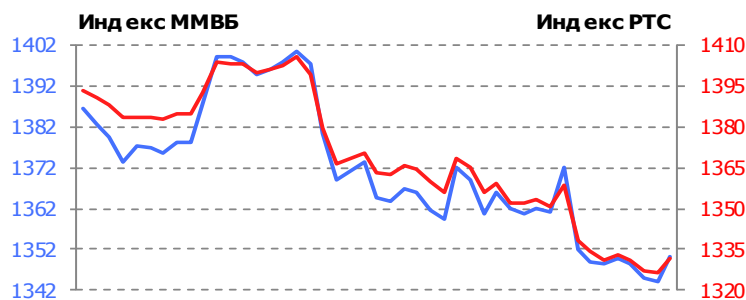
Индекс акций второго эшелона упал на 1,31% до 3 027,00 пунктов (3 067,05 пунктов на 24 мая 2013г.). Индекс акций широкого рынка потерял в весе 2,19% и составил 956,34 пунктов (977,74 пунктов на 24 мая 2013г.).

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ

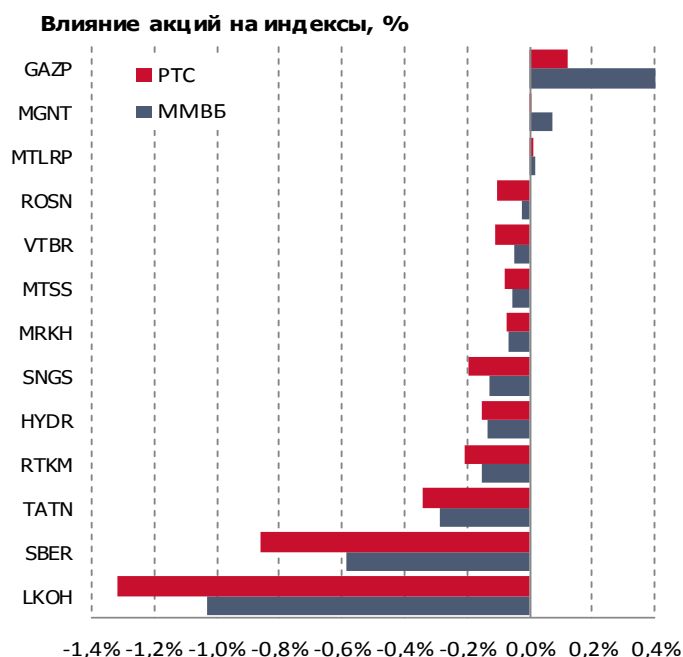


КОМПОЗИТНЫЕ ИНДЕКСЫ





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



За неделю с 27 по 31 мая 2013г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ понизился на 2,22% до 1 350,17 пунктов (1 380,88 пунктов на 24 мая 2013г.), долларовый Индекс РТС упал на 4,11% до 1 331,43 пунктов (1 388,52 пунктов на 24 мая 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 2,58% ниже своего закрытия месяц назад (1 385,88 пунктов на 30 апреля 2013г.) и находился на 3,35% выше аналогичного показателя год назад (1 306,42 пунктов на 31 мая 2012г.). Индекс РТС был на 5,39% ниже своего закрытия месяц назад (1 407,21 пунктов на 30 апреля 2013г.) и находился на 7,16% выше аналогичного показателя год назад (1 242,43 пунктов на 31 мая 2012г.).

Понижение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось повышением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX повысился на 2,86%.

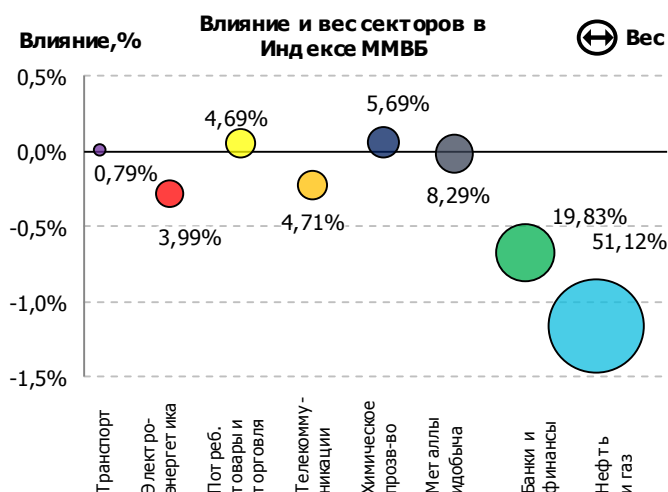
Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало понижение цен на обыкновенные акции ОАО «ЛУКОЙЛ» (-1,03%), ОАО «Сбербанк России» (-0,59%) и ОАО «Татнефть» им. В.Д. Шашина (-0,29%).

Объем торгов ценными бумагами, включенными в базу расчета индексов Московской Биржи, составил 155,86 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в состав индексов, на конец недели составила 18 467,30 млрд. руб.

По итогам недели 37 акций, входящих в базу расчета Индекса ММВБ, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-2,90%), 13 ценных бумаг повлияли положительно (+0,68%).

Наибольший вклад в падение Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги нефти и газа (-1,16%) и финансов (-0,68%).

На нефтегазовый сектор приходится 51,12% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 19,83%) и металлургия (8,29%).

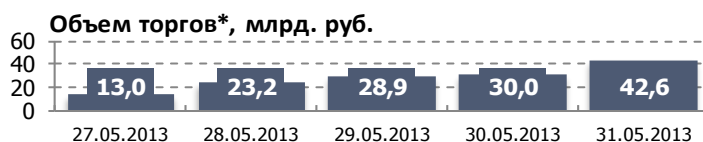


Влияние на индексы за неделю	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс ММВБ	+0,68%	-2,90%	-2,22%
Индекс РТС	+0,17%	-4,28%	-4,11%

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

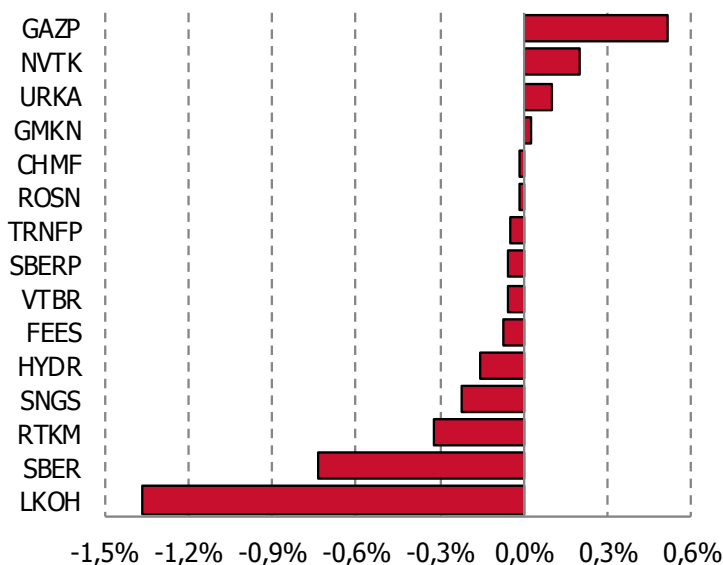
неделя с 27 по 31 мая 2013г.

Индекс голубых фишек

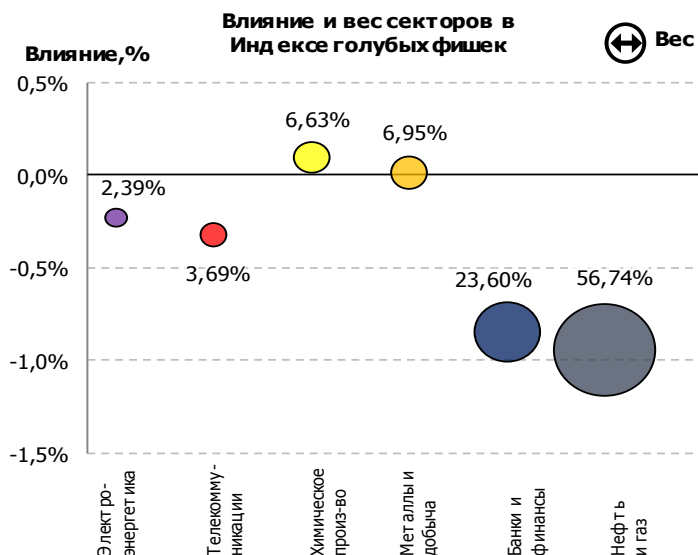


*по акциям из состава индекса голубых фишек

Влияние акций на Индекс голубых фишек, %



Изменение цены за неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние
Количество	4	11	0	15
Влияние, %	+0,84%	-3,07%	0%	-2,23%



За неделю с 27 по 31 мая 2013г. Индекс голубых фишек продемонстрировал отрицательную динамику.

Индекс голубых фишек понизился на 2,23% до 9 148,54 пунктов (9 357,66 пунктов на 24 мая 2013г.). По состоянию на конец недели Индекс голубых фишек был на 2,59% ниже своего закрытия месяц назад (9 392,15 пунктов на 30 апреля 2013г.) и находился на 0,91% выше аналогичного показателя год назад (9 066,19 пунктов на 31 мая 2012г.).

По итогам недели 11 из 15 ценных бумаг, входящих в базу расчета Индекса голубых фишек, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-3,07%), 4 акции повлияли положительно (+0,84%).

Наиболее негативно на динамике Индекса голубых фишек отразилось падение цен обыкновенных акций ОАО «ЛУКОЙЛ», влияние которых составило -1,36% и ОАО «Сбербанк России» (-0,73%).

Наибольшее позитивное влияние на динамику Индекса голубых фишек оказали обыкновенные акции ОАО «Газпром» (+0,51%) и ОАО «НОВАТЭК» (+0,20%).

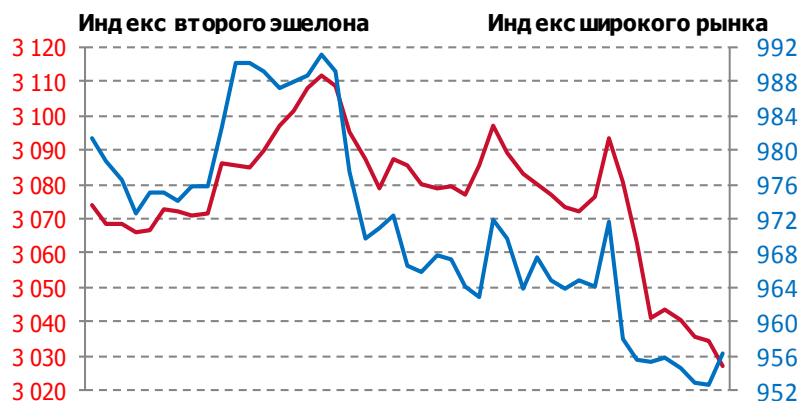
На нефтегазовый сектор приходится 56,74% суммарной капитализации индекса голубых фишек. Среди остальных отраслей выделяются финансовый сектор (вес в индексе 23,60%) и металлургия (6,95%).

Код	Наименование	Вес в Индексе голубых фишек	Вес в индексе ММВБ
CHMF	Северсталь, ао	1,30%	1,02%
FEES	ФСК ЕЭС, ао	0,93%	0,72%
GAZP	Газпром, ао	18,98%	14,86%
GMKN	ГМК Норильский никель, ао	5,65%	4,42%
HYDR	РусГидро, ао	1,46%	1,15%
LKOH	ЛУКОЙЛ, ао	19,35%	15,14%
NVTK	НОВАТЭК, ао	5,06%	3,96%
ROSN	НК Роснефть, ао	5,72%	4,47%
RTKM	Ростелеком, ао	3,69%	2,89%
SBER	Сбербанк России, ао	18,80%	14,71%
SBERP	Сбербанк России, ап	1,33%	1,04%
SNGS	Сургутнефтегаз, ао	4,61%	1,82%
TRNFP	АК Транснефть, ап	3,02%	2,36%
URKA	Уралкалий, ао	6,63%	5,19%
VTBR	Банк ВТБ, ао	3,47%	2,72%
Всего		100,00%	76,47%

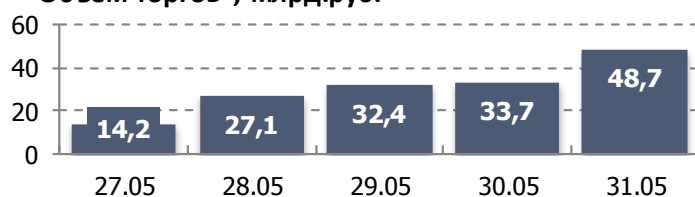
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 27 по 31 мая 2013г.

Индексы широкого рынка и второго эшелона

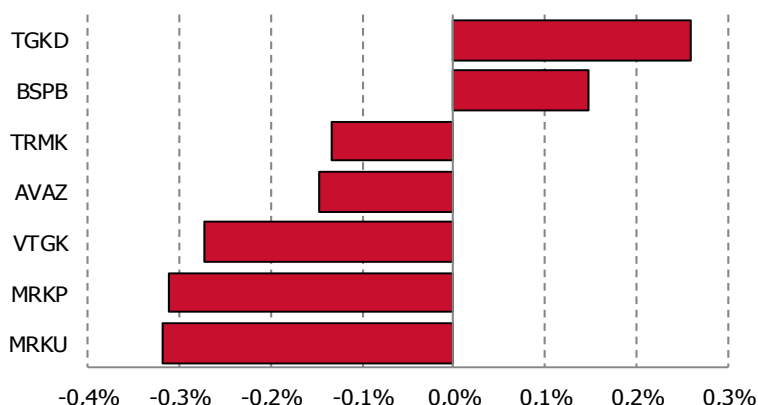


Объем торгов*, млрд.руб.

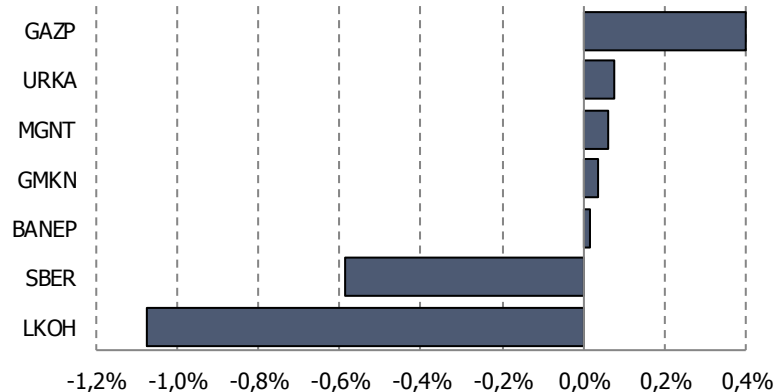


*по акциям из состава Индекса широкого рынка

Влияние акций на Индекс второго эшелона, %



Влияние акций на Индекс широкого рынка, %



За неделю с 27 по 31 мая 2013г. Индекс акций второго эшелона упал на 1,31% до 3 027,00 пунктов (3 067,05 пунктов на 24 мая 2013г.). Индекс акций широкого рынка потерял в весе 2,19% и составил 956,34 пунктов (977,74 пунктов на 24 мая 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс второго эшелона был на 0,43% ниже своего закрытия месяц назад (3 040,13 пунктов на 30 апреля 2013г.) и находился на 4,43% ниже аналогичного показателя год назад (3 167,43 пунктов на 31 мая 2012г.).

Индекс широкого рынка был на 2,62% ниже своего закрытия месяц назад (982,10 пунктов на 30 апреля 2013г.) и находился на 2,54% выше аналогичного показателя год назад (932,63 пунктов на 31 мая 2012г.).

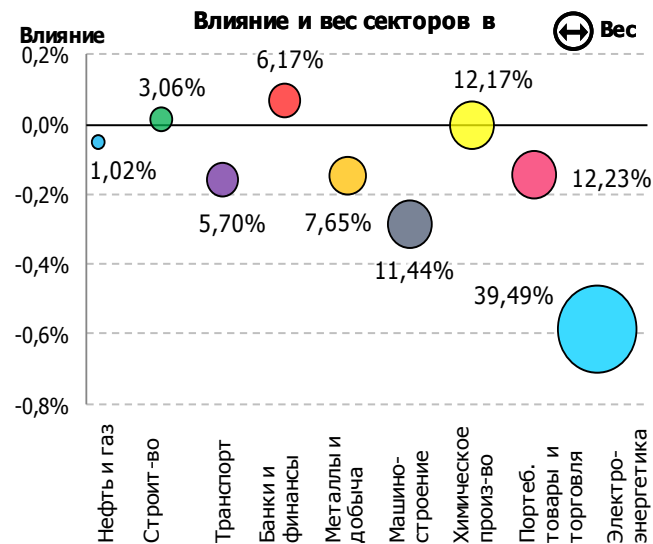
По итогам недели 32 ценные бумаги, входящие в базу расчета Индекса второго эшелона, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-2,18%), 16 акций повлияли положительно (+0,87%), цена 1 ценной бумаги не изменилась.

Наибольшее негативное влияние на динамику Индекса второго эшелона оказали обыкновенные акции ОАО «МРСК Урала» (-0,32%) и ОАО «МРСК Центра и Приволжья» (-0,31%).

Наиболее негативно на динамике Индекса широкого рынка отразилось падение цен обыкновенных акций ОАО «ЛУКОЙЛ» (-1,08%) и ОАО «Сбербанк России» (-0,59%).

Наибольший вклад в падение Индекса второго эшелона по итогам недели внесли ценные бумаги электроэнергетики (-0,59%) и машиностроения (-0,29%).

На электроэнергетику приходится 39,49% суммарной капитализации Индекса второго эшелона. Среди остальных отраслей выделяются потребительский сектор (вес в индексе 12,23%) и химическое производство (12,17%).

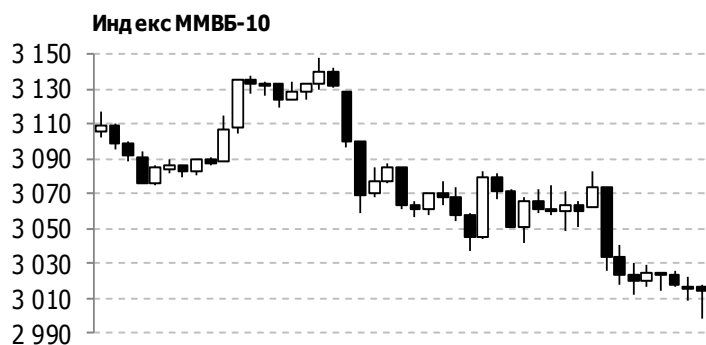


Влияние на индексы за неделю	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс второго эшелона	+0,87%	-2,18%	-1,31%
Индекс широкого рынка	+0,68%	-2,87%	-2,19%

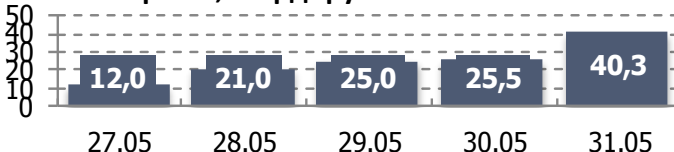
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 27 по 31 мая 2013г.

Индекс ММВБ-10

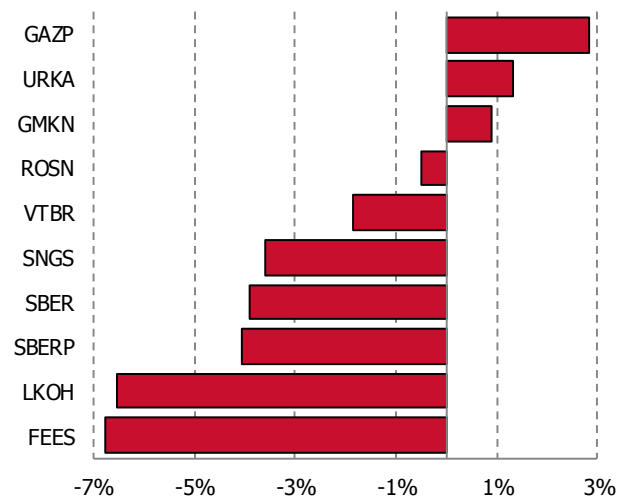


Объем торгов*, млрд. руб.



*по акциям из состава индекса ММВБ-10

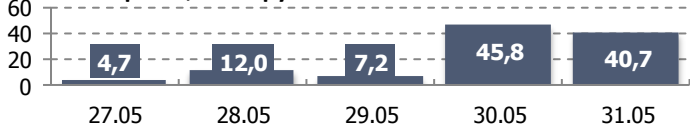
Прирост цен акций в Индексе ММВБ-10, %



Индекс ММВБ Инновации

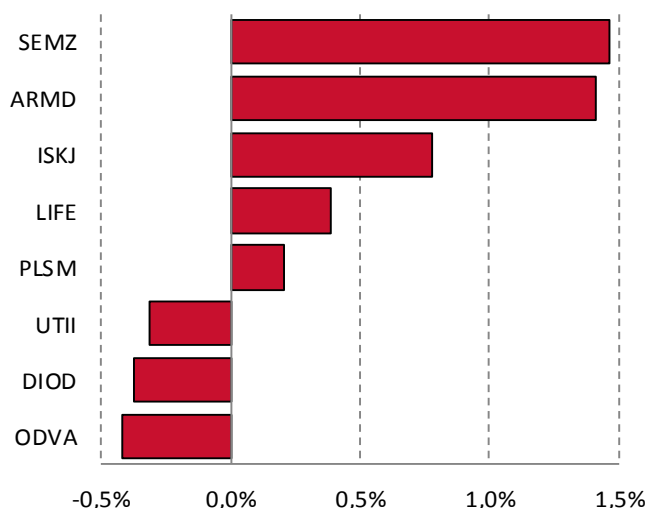


Объем торгов*, млн. руб.



*по акциям из состава индекса ММВБ Инновации

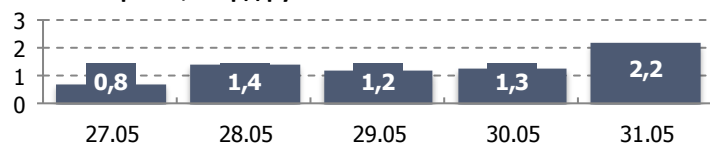
Влияние акций на индекс ММВБ Инновации, %



Индекс РТС Сибирь

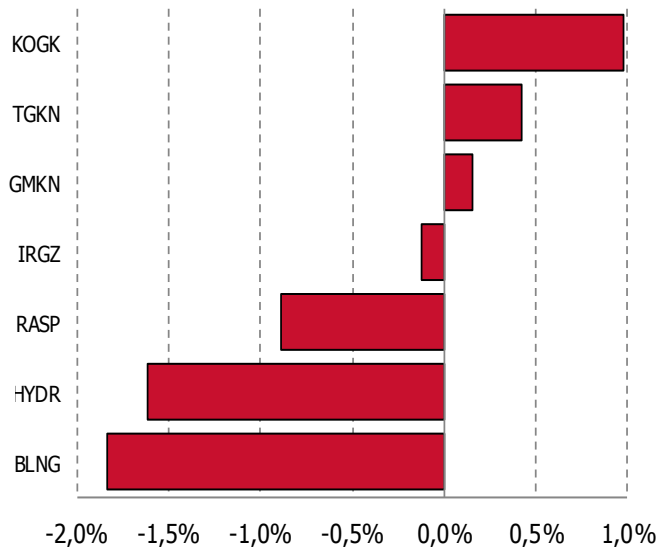


Объем торгов*, млрд руб.



*по акциям из состава индекса РТС Сибирь

Влияние акций на Индекс РТС Сибирь, %



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 27 по 31 мая 2013г.

Долговой рынок

Индекс	Значение	Изменение за период			
	31.05.2013	неделя	месяц	квартал	год
Индексы государственных облигаций					
RGBI	136,15	-1,48%	-3,67%	-1,88%	-14,30%
RGBI-tr	317,87	-1,32%	-3,01%	-0,08%	147,91%
Доходность	7,00%	23 б.п.	64 б.п.	62 б.п.	-119 б.п.
Индексы корпоративных облигаций					
MICEXCBICP	93,49	-0,19%	-0,15%	-0,01%	1,66%
MICEXCBITR	233,32	-0,03%	0,54%	2,04%	9,93%
Доходность	7,95%	8 б.п.	2 б.п.	-11 б.п.	-107 б.п.
Индексы муниципальных облигаций					
MICEXMBICP	97,72	-0,04%	0,12%	0,12%	1,40%
MICEXMBITR	173,03	0,14%	0,78%	2,02%	76,02%
Доходность	7,66%	2 б.п.	-5 б.п.	-14 б.п.	-53 б.п.
Индексы активов пенсионных накоплений					
Консервативный	1 558,02	0,09%	0,57%	2,06%	8,33%
Сбалансированный	1 363,19	-0,53%	0,31%	0,12%	6,56%
Агрессивный	1 170,78	-1,34%	-0,04%	-2,23%	5,19%
Индикаторы ставок РЕПО по акциям					
Овернайт	6,24%	0 б.п.	-6 б.п.	23 б.п.	-10 б.п.
1 неделя	4,95%	-107 б.п.	-134 б.п.	-44 б.п.	-177 б.п.
2 недели	5,42%	-198 б.п.	-111 б.п.	-123 б.п.	-193 б.п.
Индикаторы ставок РЕПО по облигациям					
Овернайт	6,19%	-2 б.п.	-19 б.п.	3 б.п.	-52 б.п.
1 неделя	6,60%	-107 б.п.	26 б.п.	140 б.п.	-7 б.п.
2 недели	6,84%	109 б.п.	31 б.п.	55 б.п.	28 б.п.

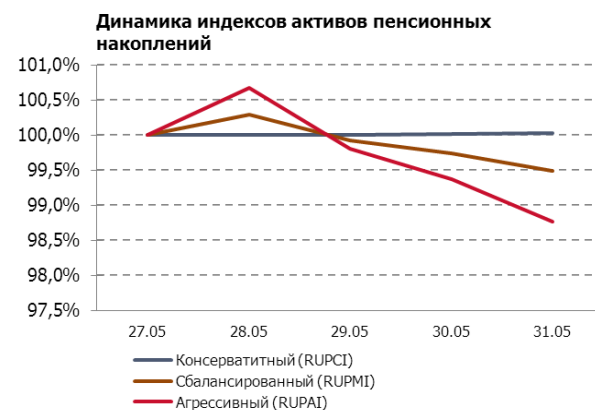
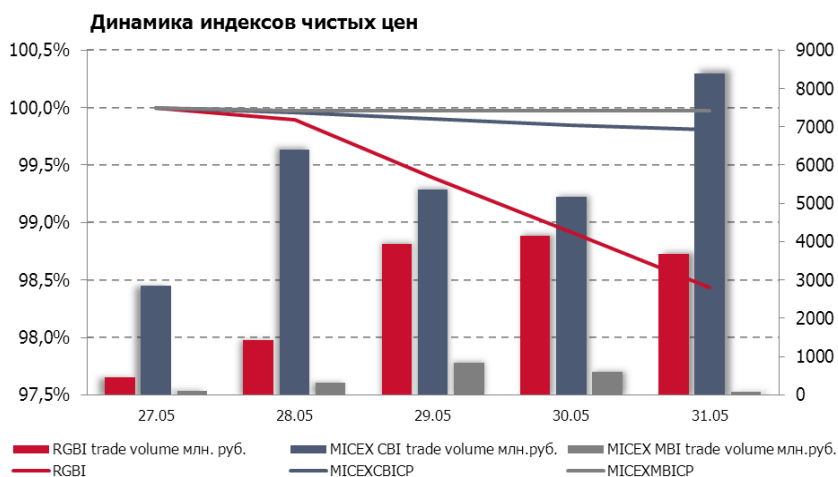
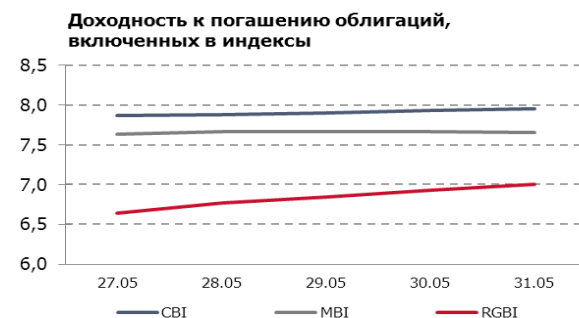
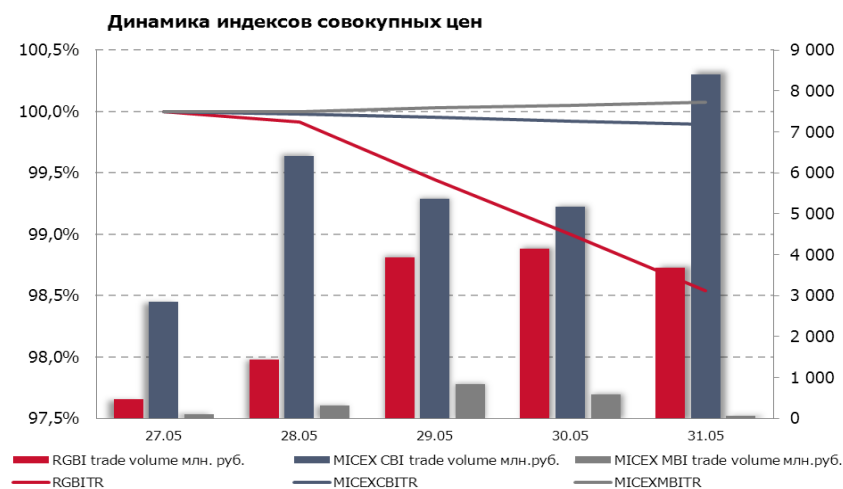
На прошедшей неделе ценовой Индекс государственных облигаций России (RGBI) снизился на 1,71% до 136,15 пунктов (138,20 на 24 мая 2013 г.). При этом средневзвешенная доходность облигаций, входящих в базу расчета индекса, выросла на 23 базисных пунктов и составила 7,00%.

Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI TR (совокупный доход) показал положительную динамику и составил 173,03 пункта, рост на 0,14% (172,79 на 24 мая 2013 г.).

В секторе корпоративных облигаций индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, MICEX CBI TR снизился на 0,03% и составил 233,32 пункта.

Консервативная стратегия вложения средств по индексу пенсионных накоплений обеспечила бы рост на уровне 0,09% за неделю, агрессивная стратегия - снижение на 1,34% за неделю.

Ставка РЕПО овернайт по облигациям за прошедшую неделю изменилась с 6,21% до 6,19% (снижение на 2 базисных пункта). Ставка РЕПО овернайт по акциям за прошедшую неделю осталась без изменений и составила 6,24%.



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 27 по 31 мая 2013г.

Производные на индексы



За неделю с 27 по 31 мая 2013г. объем торгов производными инструментами на индексы на Московской Бирже составил 673,85 млрд. рублей или 7,78 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 581,11 млрд. рублей или 6,74 млн. контрактов.

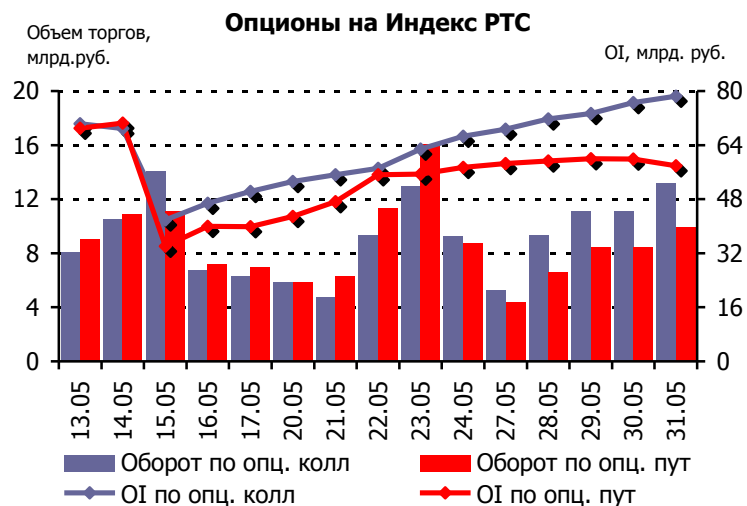
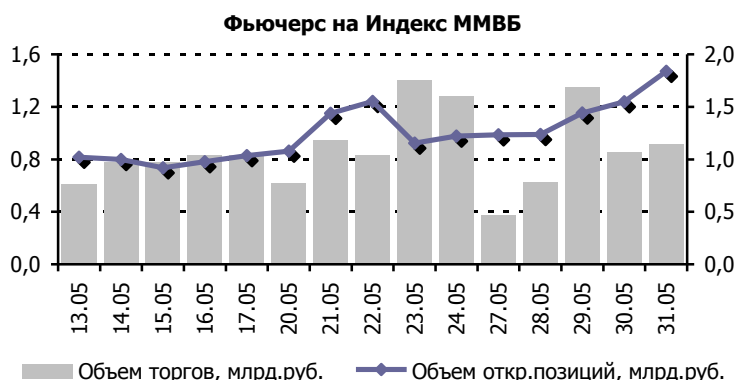
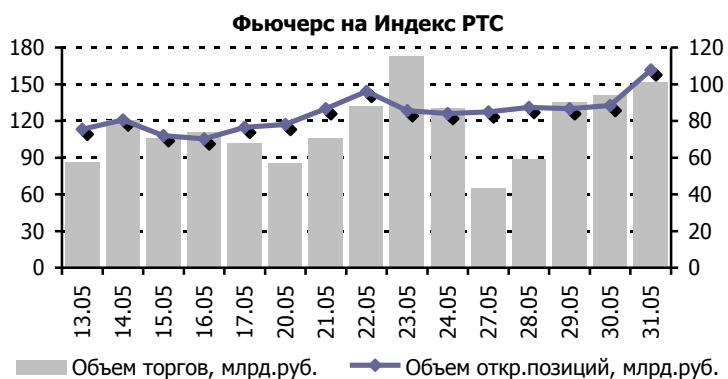
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе преимущественно торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю потерял в весе 4,11%, при этом июньские и сентябрьские фьючерсы подешевели на 4,65% и на 4,47% соответственно.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю вырос на 32,04%

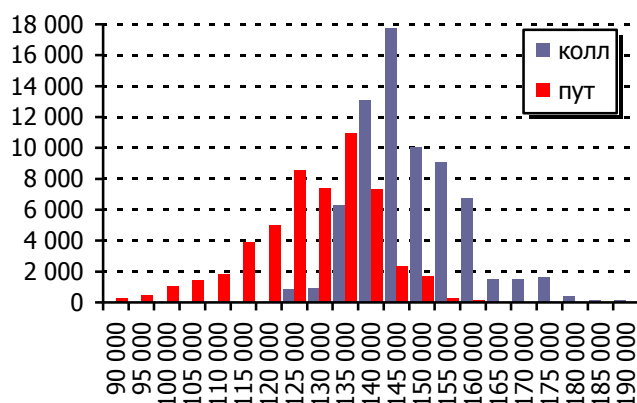
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ составил на прошедшей неделе 4,11 млрд. рублей или 29,96 тыс. контрактов. За неделю было отмечено увеличение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ на 55,14%

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 87,82 млрд. рублей или 1,01 млн. контрактов. Объем открытых позиций составил 136,34 млрд. рублей или 1,54 млн. контрактов. При этом на долю опционов пут приходилось 42,44% 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 8,09%.



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(RTSch) – 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 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 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 – 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 рублях Российской Федерации и в долларах США.

Индекс акций широкого рынка – индикатор, включающий ТОП 100 ценных бумаг, отобранных на основании критериев ликвидности, капитализации и доли акций, находящиеся в свободном обращении (free-float) и является основой для формирования баз расчета остальных индексов Московской Биржи. ТОП-50 корзины индекса широкого рынка составляют базу расчета Индекса ММВБ и Индекса РТС, а оставшиеся 50 акций – корзину Индекса второго эшелона. В базу расчета каждого отраслевого индекса включаются акции соответствующего сектора, входящие в состав Индекса акций широкого рынка.

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 дюрации 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