

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

Индекс	Значение 02.08.2013	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 392,15	-0,78%	4,05%	1,13%	-0,35%
Индекс РТС	1 336,39	-0,89%	4,89%	-3,68%	-1,40%
Индекс голубых фишек	9 396,66	-1,10%	4,06%	0,43%	-1,44%
Индекс второго эшелона	3 020,38	-0,03%	0,89%	-1,47%	-7,59%
Индекс широкого рынка	985,57	-0,76%	4,08%	1,01%	-0,53%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	3 214,48	-0,40%	4,72%	8,52%	8,43%
Электроэнергетика	1 225,30	1,22%	5,46%	-6,29%	-29,28%
Потребительский сектор	5 798,60	-0,62%	-0,08%	3,19%	23,53%
Телекоммуникации	2 223,08	-0,61%	12,74%	6,59%	5,42%
Машиностроение	1 784,54	-1,74%	-1,49%	2,41%	-1,01%
Финансы	4 593,51	3,64%	4,83%	8,79%	-3,28%
Химия и нефтехимия	7 867,57	-10,02%	-14,86%	-18,30%	-20,46%
Металлы и добыча	2 101,75	0,83%	3,29%	-7,36%	-22,89%
Тематические индексы					
Индекс ММВБ-10	3 053,13	-1,89%	0,98%	-2,32%	-6,43%
Индекс Волатильности	21,12	-2,27%	-22,69%	1,15%	-41,35%
Индекс ММВБ Инновации	447,90	2,55%	0,70%	10,24%	-29,88%
Индекс РТС Сибирь	460,97	1,79%	1,76%	-9,47%	-30,91%
Курс доллара (ЦБ РФ)					
USD / RUB	32,97	1,34%	0,37%	6,22%	1,99%

За неделю с 29 июля по 2 августа 2013г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ понизился на 0,78% до 1 392,15 пунктов (1 403,14 пунктов на 26 июля 2013г.), долларовый Индекс РТС упал на 0,89% до 1 336,39 пунктов (1 348,37 пунктов на 26 июля 2013г.).

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 1,34%.

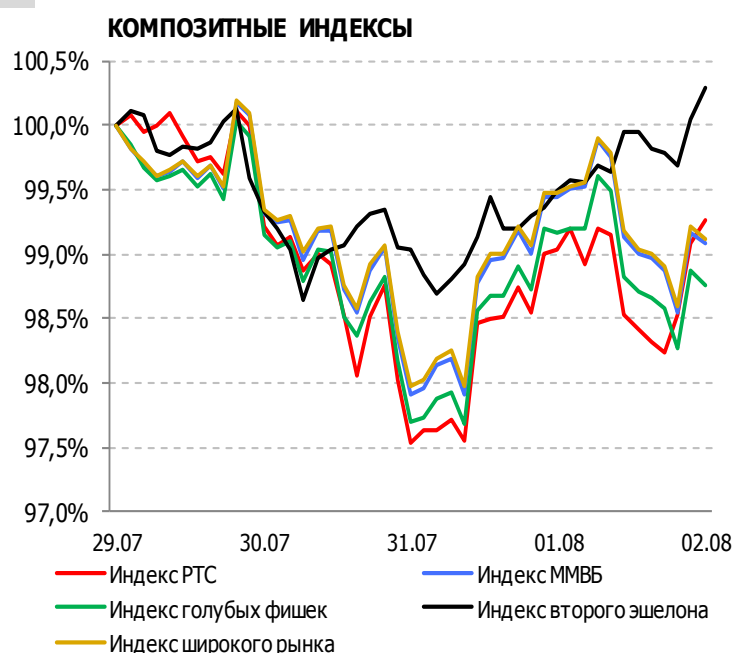
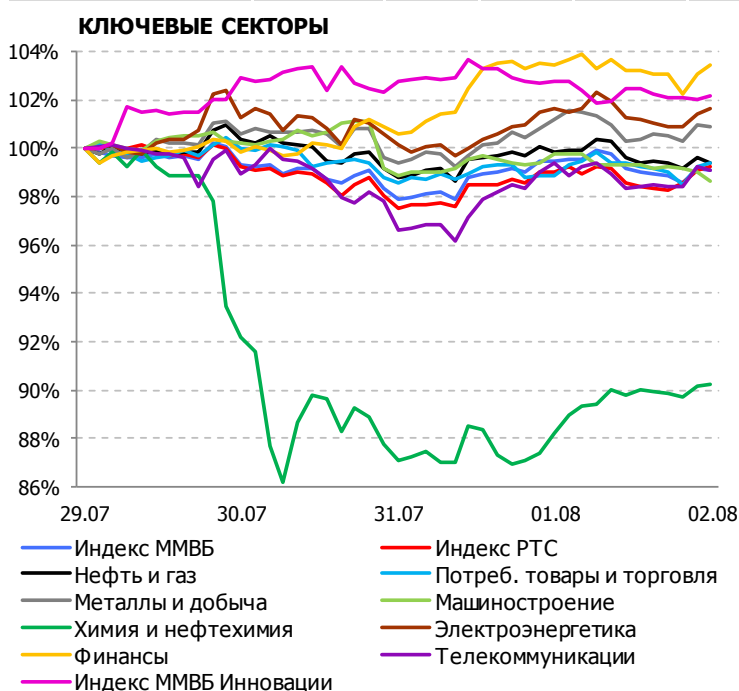
На фондовом рынке наблюдалось понижение волатильности: Российский индекс волатильности понизился на 2,27% до 21,12 пункта (21,61 пункта на 26 июля 2013г.).

На прошедшей неделе большинство ключевых секторов экономики, представленных на российском фондовом рынке, показали отрицательную динамику. Лидером падения стала химия и нефтехимия: понижение по отраслевому индексу составило 10,02%. Также существенное снижение продемонстрировали машиностроительный и потребительский секторы – Индекс машиностроения упал на 1,74%, а Индекс потребительского сектора потерял в весе 0,62%. Наибольший рост был отмечен в финансовом секторе – Индекс финансов повысился на 3,64%.

Индекс ММВБ Инновации повысился на 2,55% до 447,90 пунктов (436,78 пунктов на 26 июля 2013г.).

Индекс голубых фишек упал на 1,10% до 9 396,66 пунктов (9 501,15 пунктов на 26 июля 2013г.).

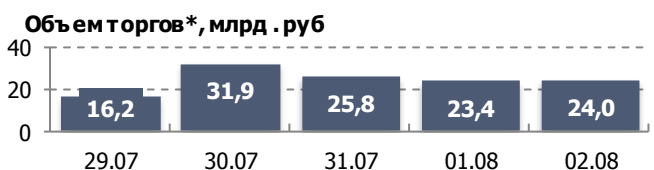
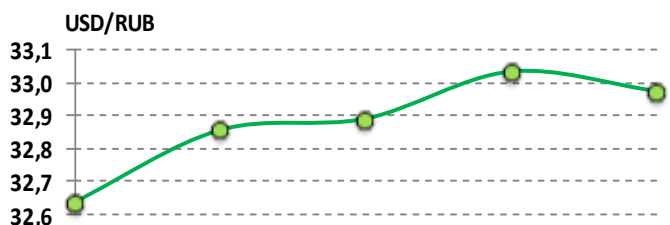
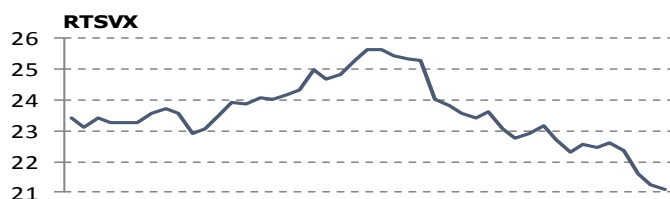
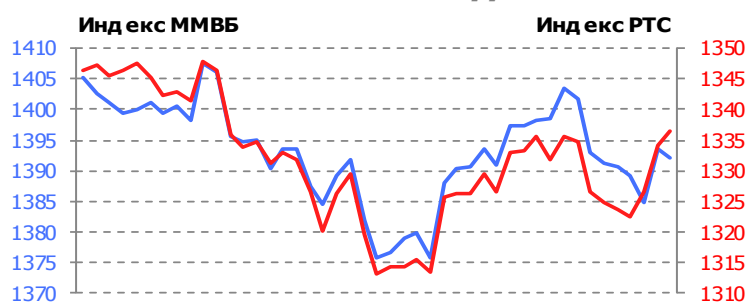
Индекс акций второго эшелона понизился на 0,03% до 3 020,38 пунктов (3 021,24 пунктов на 26 июля 2013г.). Индекс акций широкого рынка потерял в весе 0,76% и составил 985,57 пунктов (993,07 пунктов на 26 июля 2013г.).



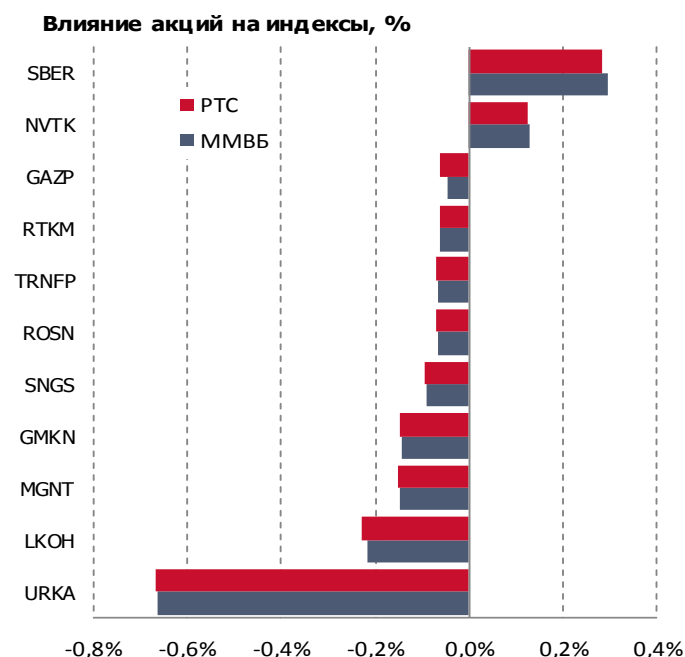
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

Основные индексы Московской Биржи – ММВБ и РТС



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



За неделю с 29 июля по 2 августа 2013г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику по индексам Московской Биржи. Индекс ММВБ понизился на 0,78% до 1 392,15 пунктов (1 403,14 пунктов на 26 июля 2013г.), долларовый Индекс РТС упал на 0,89% до 1 336,39 пунктов (1 348,37 пунктов на 26 июля 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 4,05% выше своего закрытия месяц назад (1 337,92 пунктов на 2 июля 2013г.) и находился на 0,35% ниже аналогичного показателя год назад (1 397,05 пунктов на 2 августа 2012г.). Индекс РТС был на 4,89% выше своего закрытия месяц назад (1 274,07 пунктов на 2 июля 2013г.) и находился на 1,40% ниже аналогичного показателя год назад (1 355,32 пунктов на 2 августа 2012г.).

Понижение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось понижением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX понизился на 2,27%.

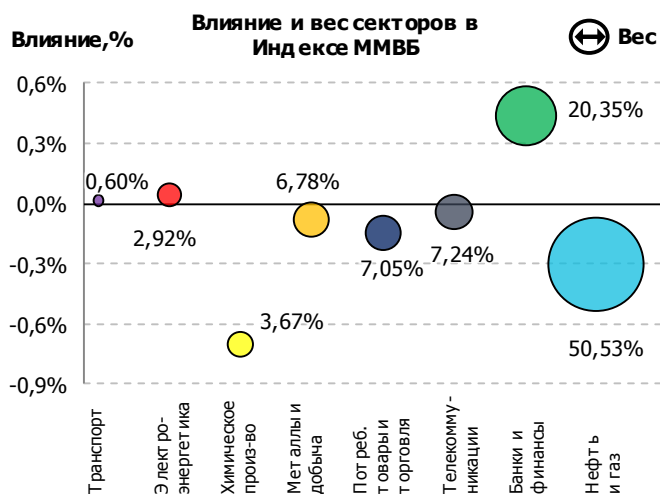
Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало понижение цен на обыкновенные акции ОАО «Уралкалий» (-0,67%), ОАО «ЛУКОЙЛ» (-0,22%) и ОАО «Магнит» (-0,15%).

Объем торгов ценными бумагами, включенными в базу расчета индексов Московской Биржи, составил 121,28 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в состав индексов, на конец недели составила 19 258,19 млрд. руб.

По итогам недели 23 акции, входящие в базу расчета Индекса ММВБ, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-1,60%), 26 ценных бумаг повлияли положительно (+0,82%). Цена 1 акции не изменилась.

Наибольший вклад в падение Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги химического производства (-0,71%) и нефти и газа (-0,30%).

На нефтегазовый сектор приходится 50,53% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 20,35%) и телекоммуникации (7,24%).



Влияние на индексы за неделю	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс ММВБ	+0,82%	-1,60%	-0,78%
Индекс РТС	+0,78%	-1,67%	-0,89%

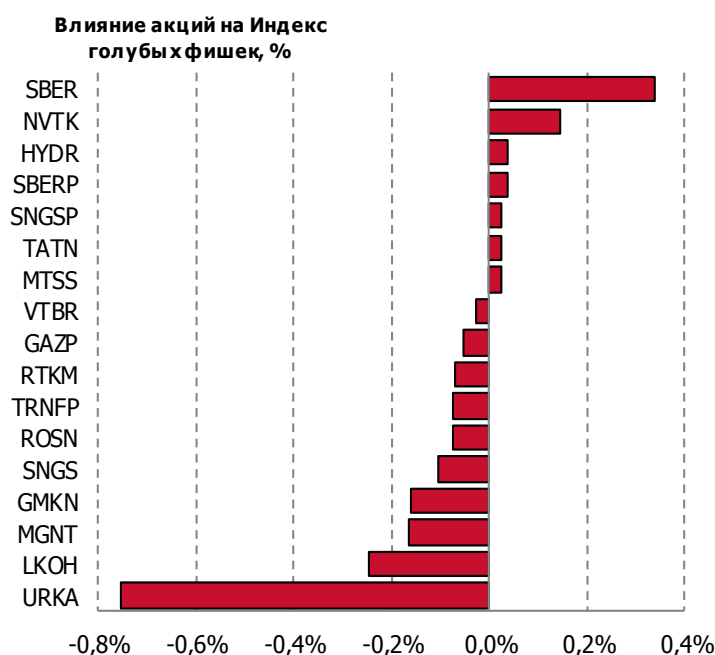
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

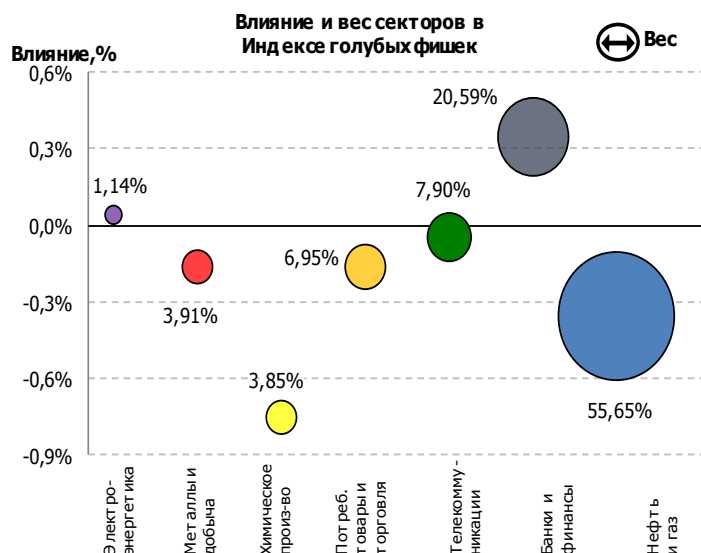
Индекс голубых фишек



*по акциям из состава индекса голубых фишек



Изменение цены за неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние
Количество бумаг	7	10	0	17
Влияние, %	+0,63%	-1,73%	0%	-1,10%



За неделю с 29 июля по 2 августа 2013г. Индекс голубых фишек продемонстрировал отрицательную динамику.

Индекс голубых фишек понизился на 1,10% до 9 396,66 пунктов (9 501,15 пунктов на 26 июля 2013г.). По состоянию на конец недели Индекс голубых фишек был на 4,06% выше своего закрытия месяц назад (9 030,11 пунктов на 2 июля 2013г.) и находился на 1,44% ниже аналогичного показателя год назад (9 533,51 пунктов на 2 августа 2012г.).

По итогам недели 10 из 17 ценных бумаг, входящих в базу расчета Индекса голубых фишек, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-1,73%), 7 акций повлияли положительно (+0,63%).

Наиболее негативно на динамике Индекса голубых фишек отразилось понижение цен обыкновенных акций ОАО «Уралкалий», влияние которых составило -0,75% и ОАО «ЛУКОЙЛ» (-0,24%).

Наиболее позитивное влияние на динамику Индекса голубых фишек оказали обыкновенные акции ОАО «Сбербанк России» (+0,34%) и ОАО «НОВАТЭК» (+0,15%).

На нефтегазовый сектор приходится 55,65% суммарной капитализации индекса голубых фишек. Среди остальных отраслей выделяются финансовый сектор (вес в индексе 20,59%) и телекоммуникации (7,90%).

Код	Наименование	Вес в Индексе голубых фишек	Вес в индексе ММВБ
GAZP	Газпром, ао	17,59%	15,45%
GMKN	ГМК Норильский никель, ао	3,91%	3,44%
HYDR	РусГидро, ао	1,14%	1,00%
LKOH	ЛУКОЙЛ, ао	16,17%	14,20%
MGNT	Магнит, ао	6,95%	6,10%
MTSS	МТС, ао	5,27%	4,63%
NVTK	НОВАТЭК, ао	5,40%	4,74%
ROSN	Роснефть, ао	5,54%	4,87%
RTKM	Ростелеком, ао	2,63%	2,31%
SBER	Сбербанк России, ао	15,13%	13,29%
SBERP	Сбербанк России, ап	1,14%	1,00%
SNGS	Сургутнефтегаз, ао	3,98%	3,50%
SNGSP	Сургутнефтегаз, ап	2,09%	1,83%
TATN	Татнефть им.В.Д.Шашина, ао	2,63%	2,31%
TRNFP	АК Транснефть, ап	2,25%	1,98%
URKA	Уралкалий, ао	3,85%	3,38%
VTBR	Банк ВТБ, ао	4,33%	3,80%
Всего		100,00%	87,84%

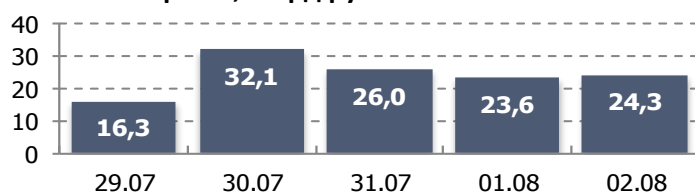
ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

Индексы широкого рынка и второго эшелона

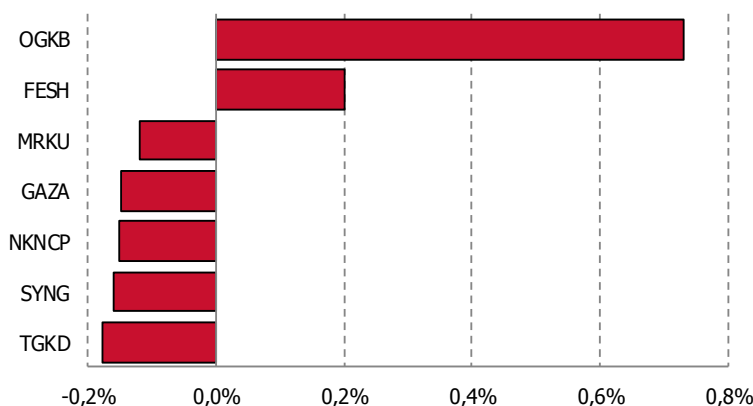


Объем торгов*, млрд.руб.

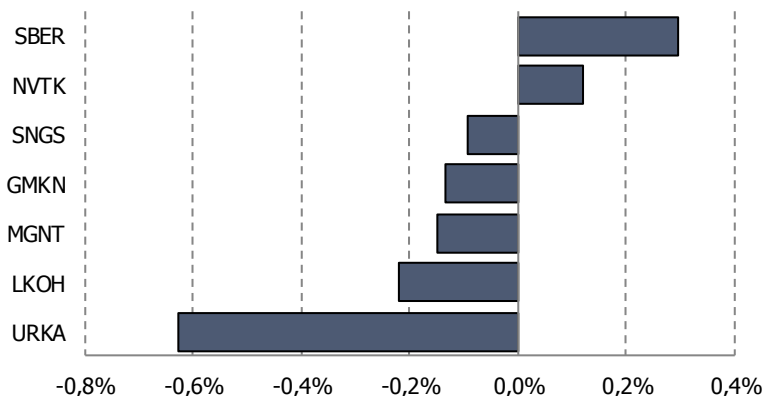


*по акциям из состава Индекса широкого рынка

Влияние акций на Индекс второго эшелона, %



Влияние акций на Индекс широкого рынка, %



За неделю с 29 июля по 2 августа 2013г. Индекс акций второго эшелона понизился на 0,03% до 3 020,38 пунктов (3 021,24 пунктов на 26 июля 2013г.). Индекс акций широкого рынка потерял в весе 0,76% и составил 985,57 пунктов (993,07 пунктов на 26 июля 2013г.).

По состоянию на конец недели Индекс второго эшелона был на 0,89% выше своего закрытия месяц назад (2 993,77 пунктов на 2 июля 2013г.) и находился на 7,59% ниже аналогичного показателя год назад (3 268,41 пунктов на 2 августа 2012г.).

Индекс широкого рынка был на 4,08% выше своего закрытия месяц назад (946,92 пунктов на 2 июля 2013г.) и находился на 0,53% ниже аналогичного показателя год назад (990,87 пунктов на 2 августа 2012г.).

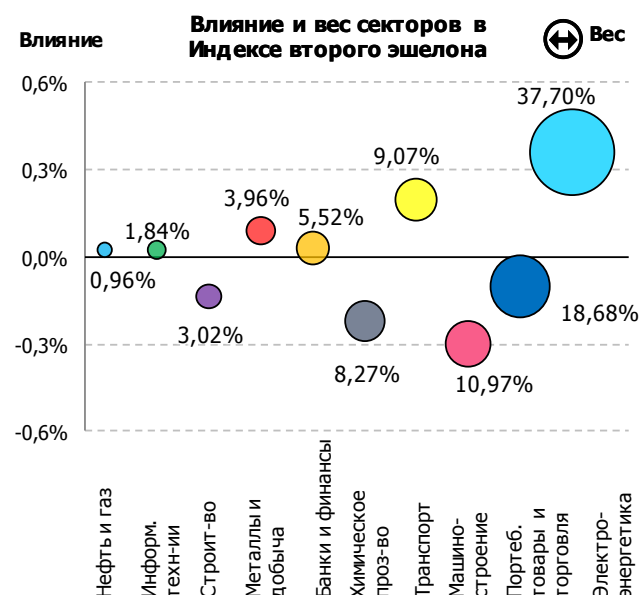
По итогам недели 36 ценных бумаг, входящих в базу расчета Индекса второго эшелона, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-1,81%), 12 акций повлияли положительно (+1,78%). Цена 2 ценных бумаг не изменилась.

Наибольшее негативное влияние на динамику Индекса второго эшелона оказали обыкновенные акции ОАО «Квадра» (-0,18%) и ОАО «Синергия» (-0,16%).

Наиболее негативно на динамике Индекса широкого рынка отразилось падение цен обыкновенных акций ОАО «Уралкалий» (-0,63%) и ОАО «ЛУКОЙЛ» (-0,22%).

Наибольший вклад в падение Индекса второго эшелона по итогам недели внесли ценные бумаги машиностроения (-0,30%) и химического производства (-0,22%).

На электроэнергетику приходится 37,70% суммарной капитализации Индекса второго эшелона. Среди остальных отраслей выделяются потребительский сектор (вес в индексе 18,68%) и машиностроение (10,97%).

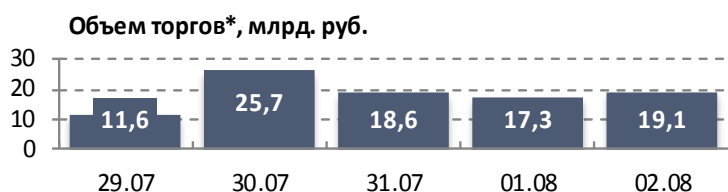
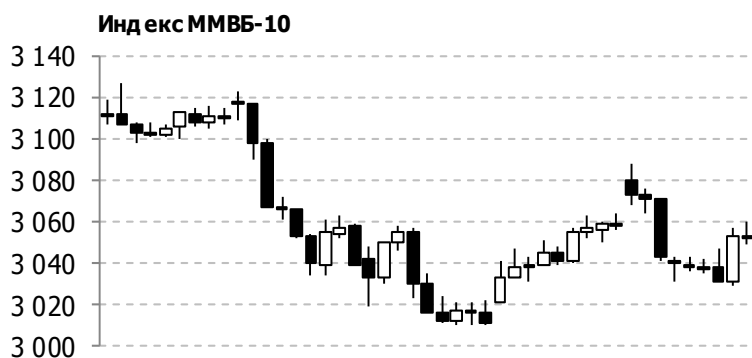


Влияние на индексы за неделю	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс второго эшелона	+1,78%	-1,81%	-0,03%
Индекс широкого рынка	+0,83%	-1,59%	-0,76%

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

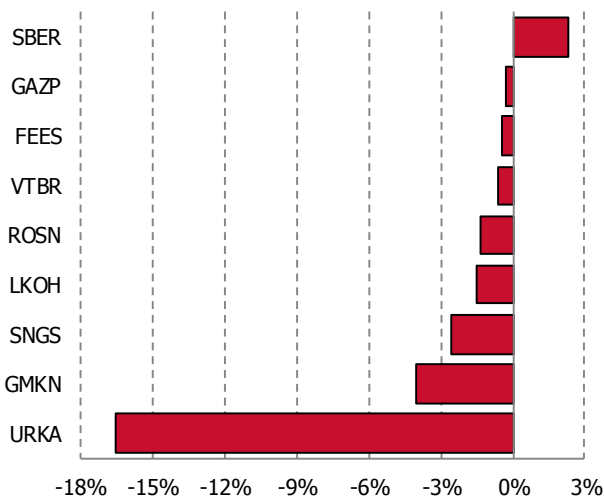
неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

Индекс ММВБ-10

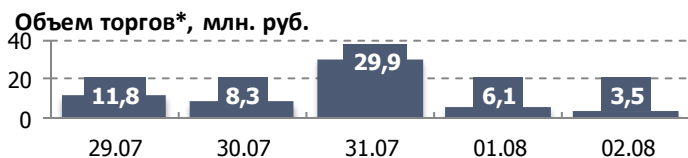


*по акциям из состава индекса ММВБ-10

Прирост цен акций в Индексе ММВБ-10, %

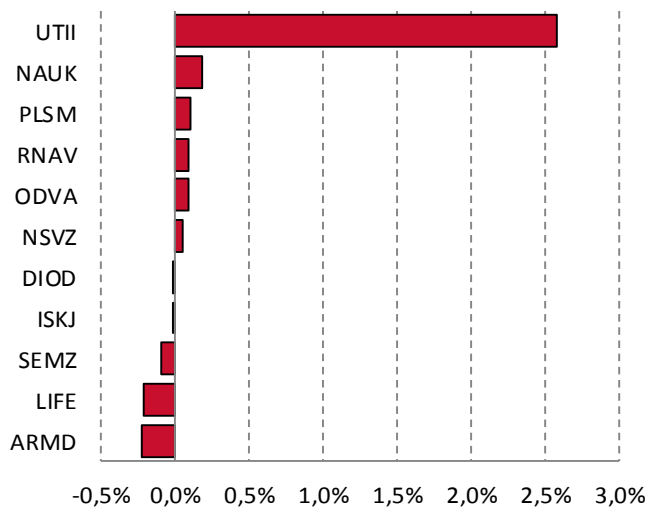


Индекс ММВБ Инновации

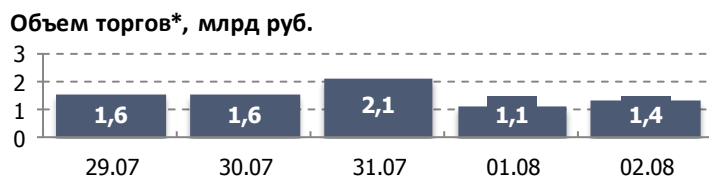
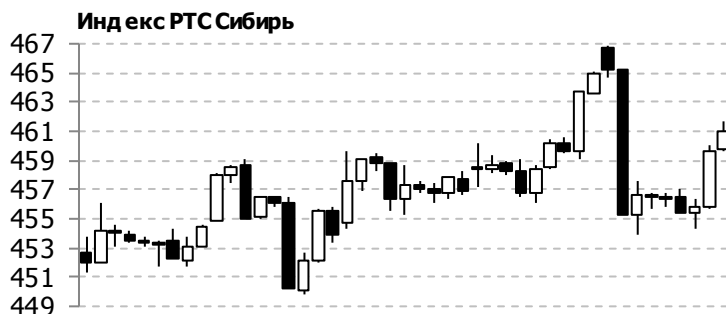


*по акциям из состава индекса ММВБ Инновации

Влияние акций на индекс ММВБ Инновации, %

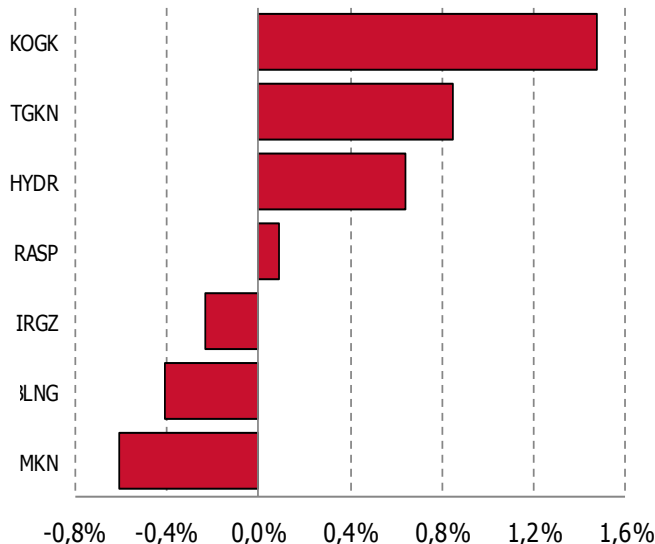


Индекс РТС Сибирь



*по акциям из состава индекса РТС Сибирь

Влияние акций на Индекс РТС Сибирь, %



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.

Долговой рынок

Индекс	Значение 02.08.2013	Изменение за период			
		неделя	месяц	квартал	год
Индексы государственных облигаций					
RGBI	134,77	-0,49%	0,36%	-4,62%	2,49%
RGBI-tr	318,75	-0,33%	0,97%	-2,76%	10,05%
Доходность	7,16	10	-7	81	-45
Индексы корпоративных облигаций					
MICEXCBIСР	93,32	-0,04%	0,33%	-0,33%	1,32%
MICEXCBITR	236,13	0,11%	1,04%	1,71%	9,70%
Доходность	7,85	-11	-28	-4	-89
Индексы муниципальных облигаций					
MICEXMBIСР	97,40	0,01%	0,07%	-0,20%	1,35%
MICEXMBITR	174,44	0,17%	0,73%	1,60%	-92,64%
Доходность	7,81	7	-1	3	-55
Индексы активов пенсионных накоплений					
Консервативный	1 576,90	0,13%	0,93%	1,77%	8,11%
Сбалансированный	1 372,95	-0,20%	1,31%	0,73%	5,11%
Агрессивный	1 178,96	-0,62%	1,80%	0,02%	2,23%
Индикаторы ставок РЕПО по акциям					
Овернайт	6,04	-9	-20	18	47
1 неделя	7,14	-31	277	102	100
2 недели	6,72	-8	-13	-13	-42
Индикаторы ставок РЕПО по облигациям					
Овернайт	6,18	-6	-3	-28	31
1 неделя	6,39	-21	-27	239	23
2 недели	7,50	104	66	97	209

На прошедшей неделе ценовой Индекс государственных облигаций России (RGBI) снизился на 0,49% до 134,77 пунктов (135,43 на 26 июля 2013 г.). При этом средневзвешенная доходность облигаций, входящих в базу расчета индекса, выросла на 10 базисных пунктов и составила 7,16%.

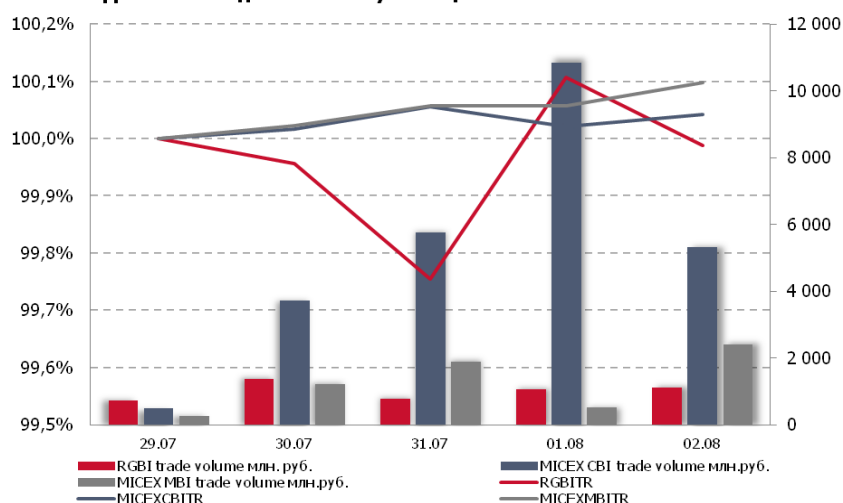
Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI TR (совокупный доход) показал положительную динамику и составил 174,44 пункта, рост на 0,14% (174,14 на 26 июля 2013 г.).

В секторе корпоративных облигаций индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, MICEX CBI TR вырос на 0,11% и составил 236,13 пунктов.

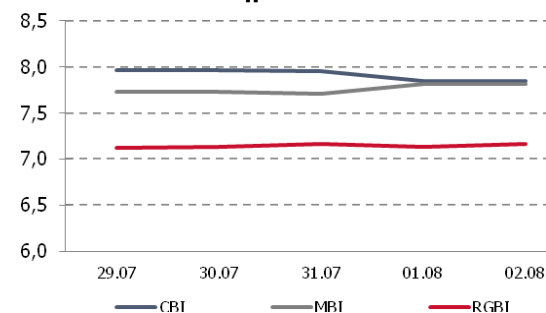
Консервативная стратегия вложения средств по индексу пенсионных накоплений обеспечила бы рост на уровне 0,13% за неделю, агрессивная стратегия – снижение на 0,62% за неделю.

Ставка РЕПО овернайт по облигациям за прошедшую неделю изменилась с 6,24% до 6,18% (снижение на 6 базисных пунктов). Ставка РЕПО овернайт по акциям на конец прошлой недели составила 6,04%.

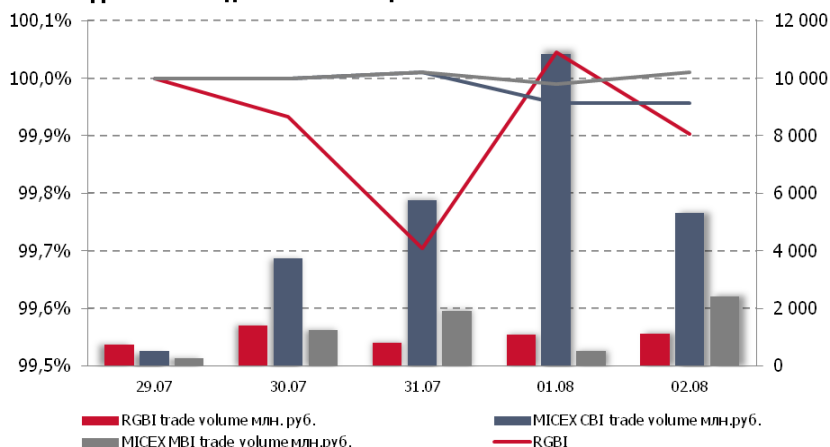
Динамика индексов совокупных цен



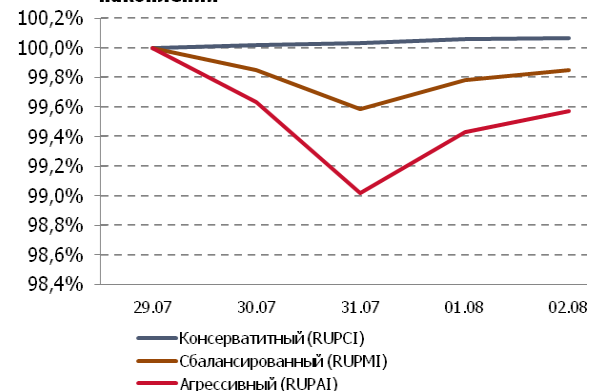
Доходность к погашению облигаций, включенных в индексы



Динамика индексов чистых цен



Динамика индексов активов пенсионных накоплений



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

неделя с 29 июля по 2 августа 2013г.
Производные на индексы



За неделю с 29 июля по 2 августа 2013г. объем торгов производными инструментами на индексы на Московской Бирже составил 463,26 млрд. рублей или 5,27 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 404,43 млрд. рублей или 4,62 млн. контрактов.

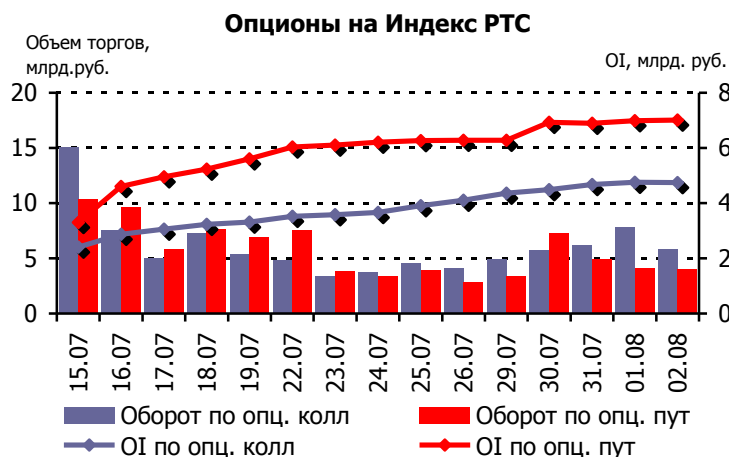
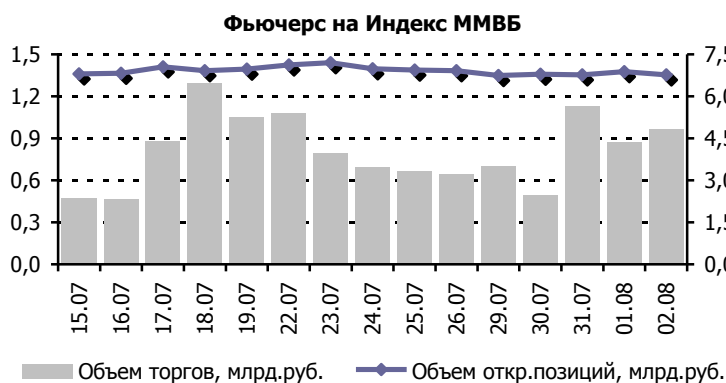
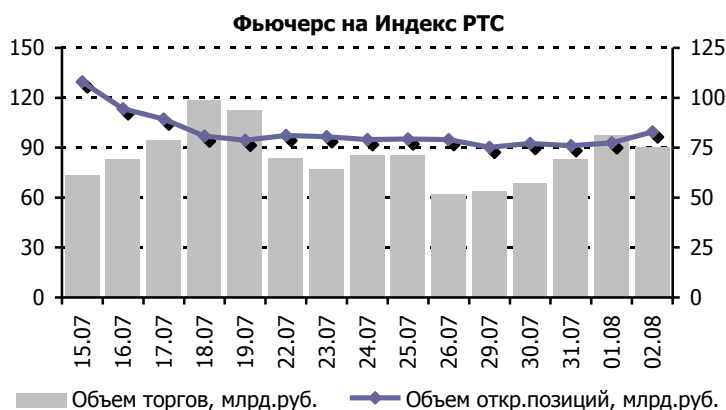
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе преимущественно торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю потерял в весе 0,89%, при этом сентябрьские и декабрьские фьючерсы подешевели на 0,80% и на 0,92% соответственно.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю вырос на 5,60%

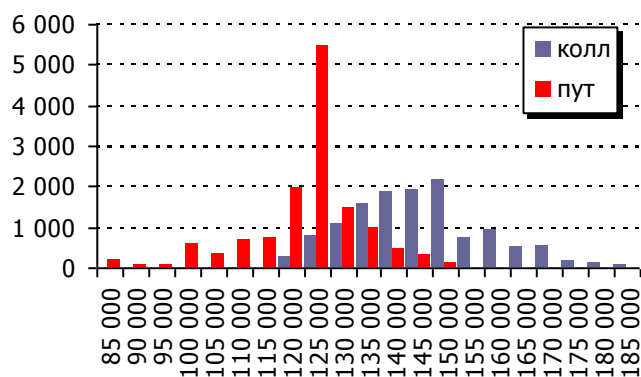
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ составил на прошедшей неделе 4,16 млрд. рублей или 29,72 тыс. контрактов. За неделю было отмечено уменьшение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ на 1,38%.

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 54,28 млрд. рублей или 618,85 тыс. контрактов. Объем открытых позиций составил 117,58 млрд. рублей или 1,37 млн. контрактов. При этом на долю опционов пут приходилось 59,64% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 150 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 125 000.

За прошедшую неделю повышение объема открытых позиций по опционам на Индекс РТС составило 13,31%.



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-9.13 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 с акциями 15-ти наиболее ликвидных эмитентов 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