

Индекс	Значение 29.02.12	Изменение за период, %			
		месяц	квартал	год	3 года
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 597,67	5,52%	6,54%	-10,13%	139,87%
Индекс РТС	1 734,99	10,00%	12,60%	-11,93%	218,59%
Индекс RTS Standard	10 955,11	5,72%	6,92%	-9,64%	--
Отраслевые индексы (руб.значения)					
Нефть и газ	3 339,02	4,74%	6,55%	-1,07%	141,46%
Электроэнергетика	2 396,37	5,92%	1,09%	-25,33%	165,57%
Потребительский сектор	4 983,68	13,67%	12,57%	-16,89%	323,04%
Телекоммуникации	2 323,00	6,09%	1,91%	-8,23%	231,54%
Машиностроение	2 087,91	8,08%	15,45%	-26,56%	289,68%
Финансы	5 569,10	2,31%	8,58%	-21,89%	220,69%
Химия и нефтехимия	7 482,07	3,54%	-1,19%	9,03%	327,79%
Металлы и добыча	3 620,94	0,62%	3,34%	-36,55%	134,32%
Капитализационные индексы					
Высокая кап-я	2 558,20	5,25%	5,17%	-10,91%	133,45%
Стандартная кап-я	2 692,24	6,01%	8,38%	-15,65%	204,10%
Базовая кап-я	3 964,23	6,63%	3,69%	-30,33%	226,49%
Тематические индексы					
Индекс волатильности	32,80	0,40%	-29,66%	28,07%	--
Индекс РТС Сибирь	771,05	4,22%	9,04%	-22,96%	220,88%
Индекс ММВБ Инновации	763,99	-0,80%	-3,58%	-33,47%	--
Курс доллара (Ц/б РФ)					
USD / RUB	28,95	-4,66%	-7,57%	0,03%	-18,96%

В феврале Индекс ММВБ повысился на 5,52% до 1 597,67 (1 514,03 на 31 января 2012г.).

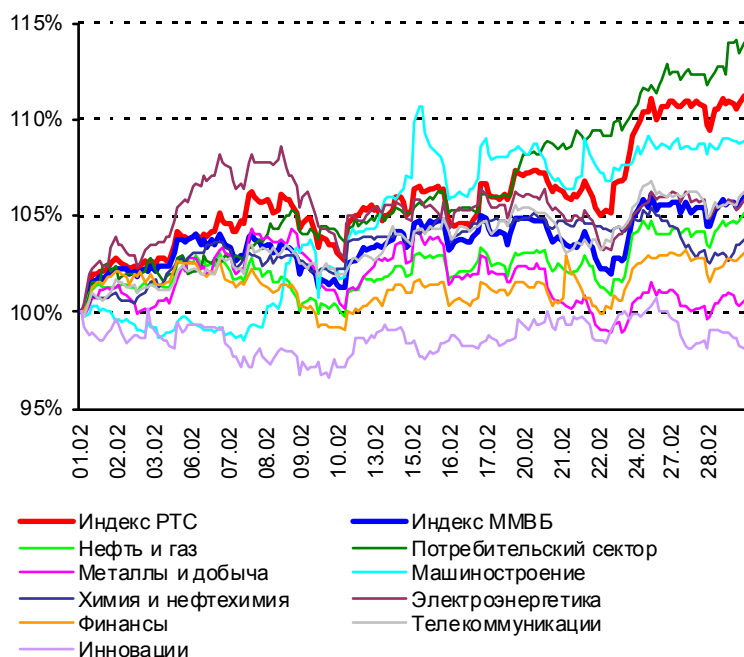
Долларовый Индекс РТС повысился на 10,00% до 1 734,99 (1 577,29 на 31 января 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедший месяц снизился на 4,66%.

На фондовом рынке наблюдалось незначительное увеличение волатильности: Российский индекс волатильности повысился на 0,40% до 32,80 пункта (32,67 пункта на 31 января 2012г.).

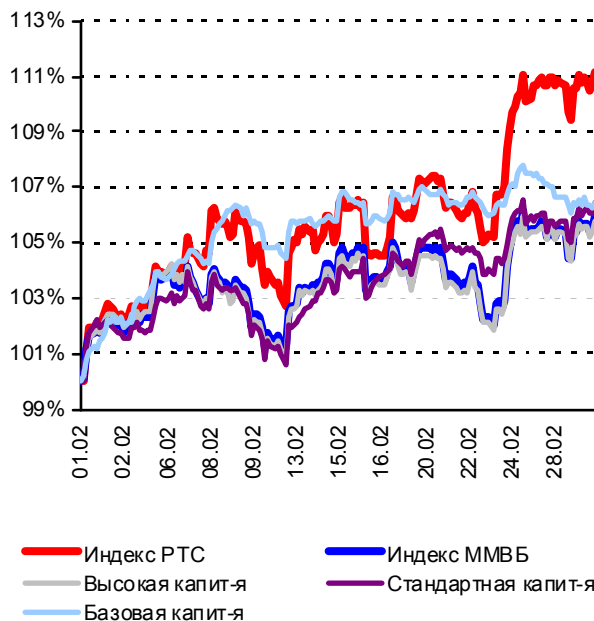
В прошедшем месяце ключевые секторы экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали положительную динамику. Лидером роста стал потребительский сектор: рост по отраслевому индексу составил 13,67%. Также существенное повышение продемонстрировали машиностроение и телекоммуникации - Индекс машиностроения прибавил в весе 8,08%, а Индекс телекоммуникаций - 6,09%. Индекс ММВБ Инновации понизился на 0,80%.

В наибольшей степени рост рынка акций затронул небольшие по капитализации компании - индекс компаний базовой капитализации прибавил в весе 6,63%, тогда как индексы компаний стандартной и высокой капитализации повысились на 6,01% и 5,25% соответственно.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ

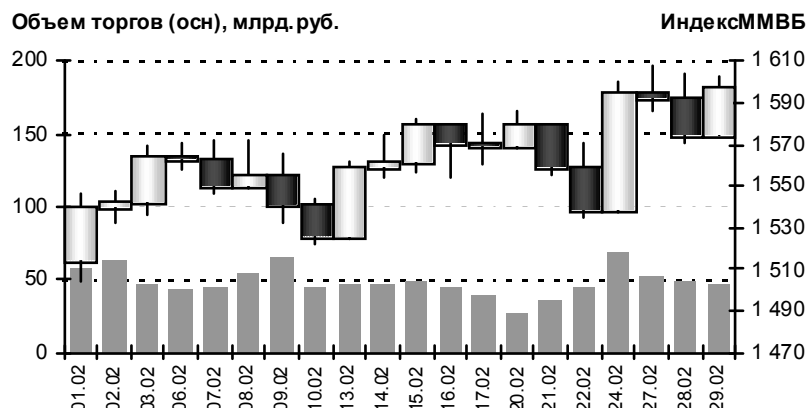


КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ



Индекс ММВБ

Объем торгов (осн), млрд. руб.



В результате описанной выше динамики Индекс ММВБ повысился на 5,52% до 1 597,67 (1 514,03 на 31 января 2012г.). По состоянию на конец месяца Индекс ММВБ был на 10,13% ниже аналогичного показателя год назад (1 777,84 на 28 февраля 2011г.).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил в прошлом месяце 972,49 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец месяца составила 21 568,85 млрд. руб.

По итогам месяца 25 из 30 акций, входящих в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику положительное воздействие (+5,76%), 5 ценных бумаг повлияли отрицательно (-0,24%).

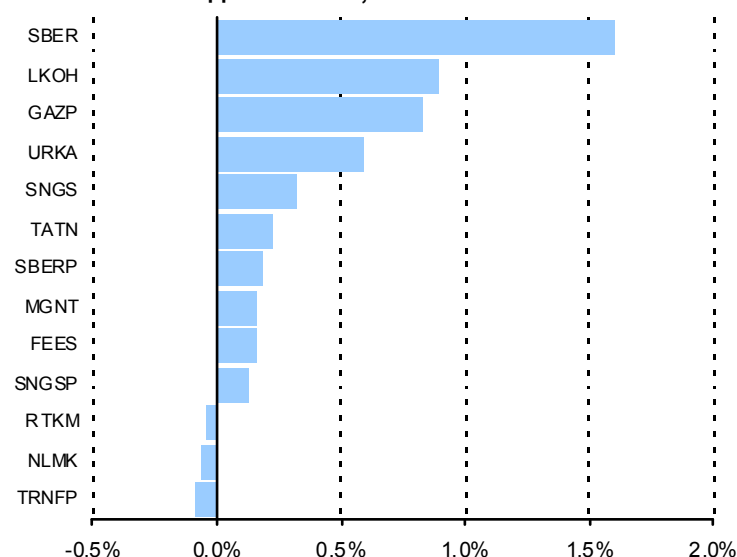
Наибольший вклад в рост Индекса ММВБ по итогам месяца внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (+2,50%) и финансов (+1,88%).

Наибольшее позитивное влияние на Индекс ММВБ оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО Сбербанк (+1,60%), ОАО ЛУКОЙЛ (+0,89%) и ОАО Газпром (+0,83%).

Наиболее негативно на динамике Индекса ММВБ отразилось снижение цен привилегированных акций ОАО АК Транснефть (-0,09%).

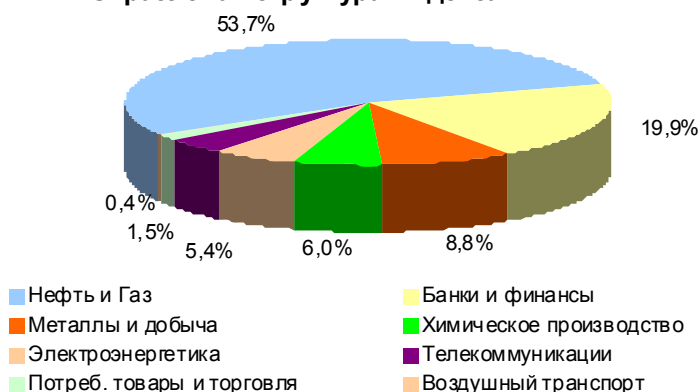
На нефтегазовый сектор приходится 53,67% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 19,93%) и металлургия (8,84%).

Влияние на Индекс ММВБ, %

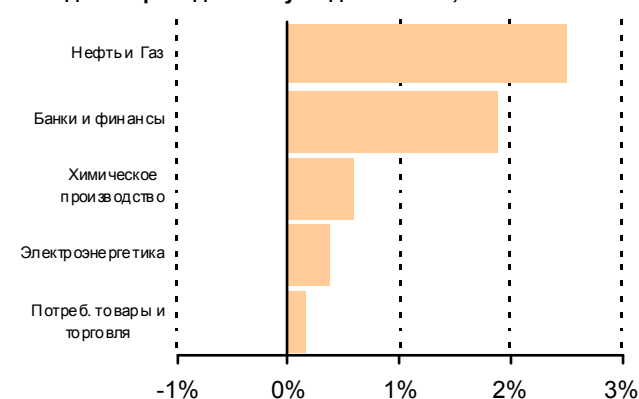


Изменение цены	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	25	5	0	30
Влияние, %	+5,76%	-0,24%	0%	+5,52%

Отраслевая структура Индекса ММВБ

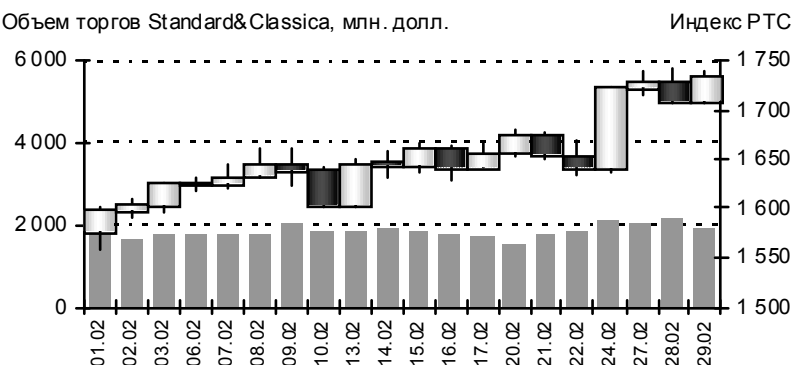


Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %



Индекс РТС

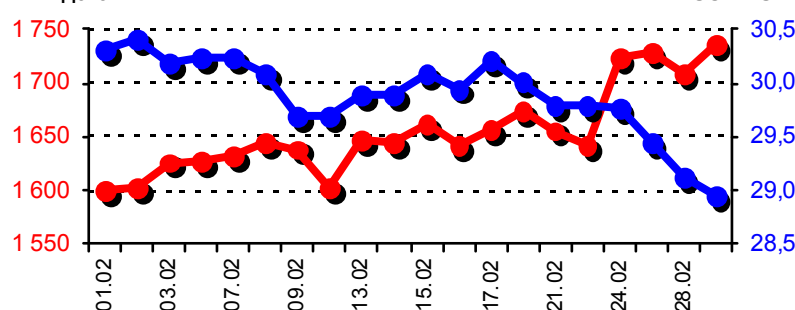
Объем торгов Standard&Classica, млн. долл.



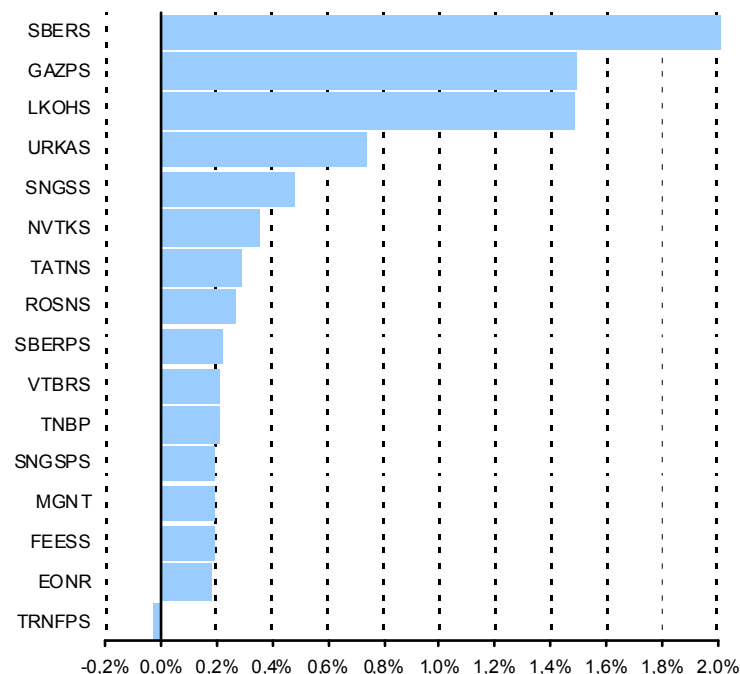
*с учетом внебиржевых сделок

Индекс РТС

USD/RUB



Влияние на Индекс РТС, %



Изменение цены	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	45	3	2	50
Влияние, %	+10,04%	-0,04%	0%	+10,00%

В результате описанной выше динамики в феврале 2012г. Индекс РТС повысился на 10,00% до 1 734,99 (1 577,29 на 31 января 2012г.). По состоянию на конец месяца Индекс РТС был на 11,93% ниже аналогичного показателя год назад (1 969,91 на 28 февраля 2011г.).

Рост Индекса РТС в прошедшем месяце сопровождался увеличением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX повысился на 0,40%.

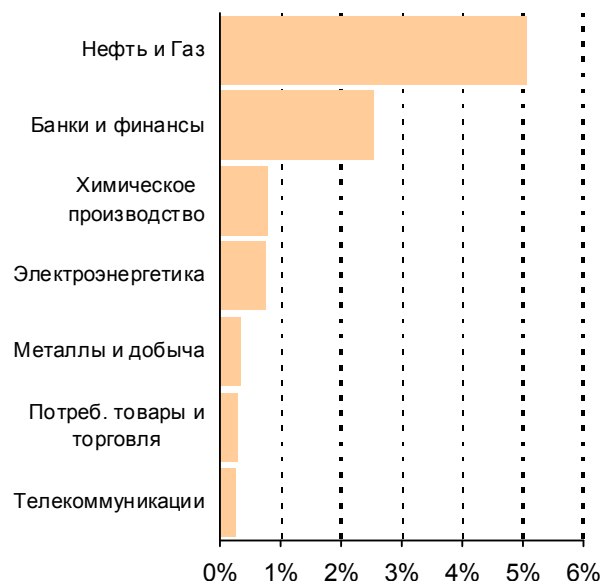
По итогам месяца 45 из 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику положительное воздействие (+10,04%), 3 ценные бумаги повлияли отрицательно (-0,04%), цена 2 бумаг не изменилась.

Наибольший вклад в рост Индекса РТС по итогам месяца внесли ценные бумаги нефтегазового (+5,07%) и финансового секторов (+2,53%).

Наибольшее позитивное влияние на Индекс РТС оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО Сбербанк (+2,01%), ОАО Газпром (+1,50%) и ОАО ЛУКОЙЛ (+1,48%).

Наиболее негативно на динамике Индекса РТС отразилось снижение цен привилегированных акций ОАО АК Транснефть (-0,03%).

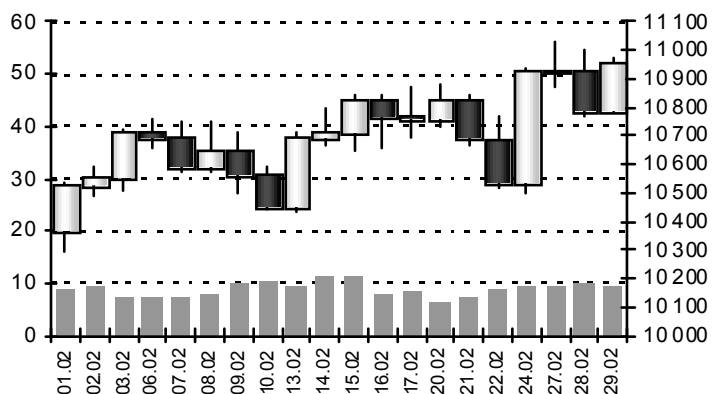
Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %



Индекс RTS Standard

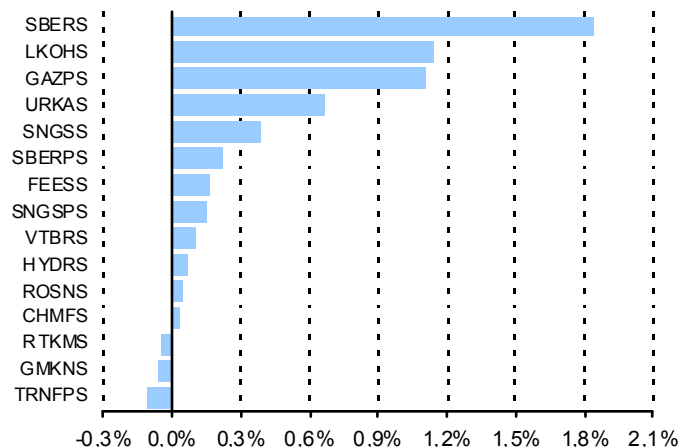
Объем торгов акц.*, млрд. руб.

Индекс RTS Standard



* по акциям из состава Индекса RTS Standard

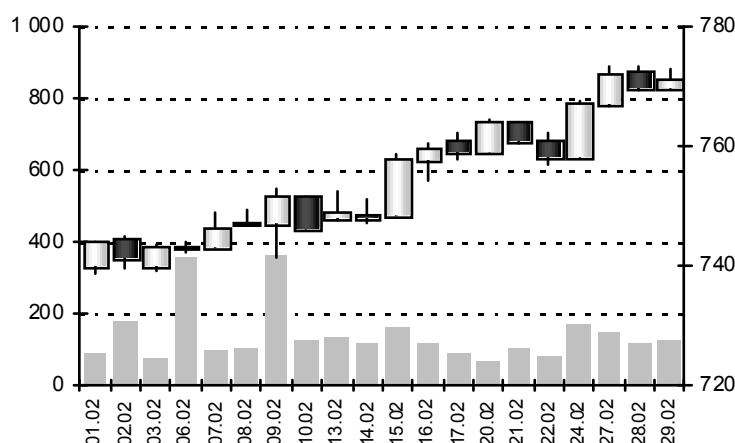
Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %



Индекс PTC Сибирь

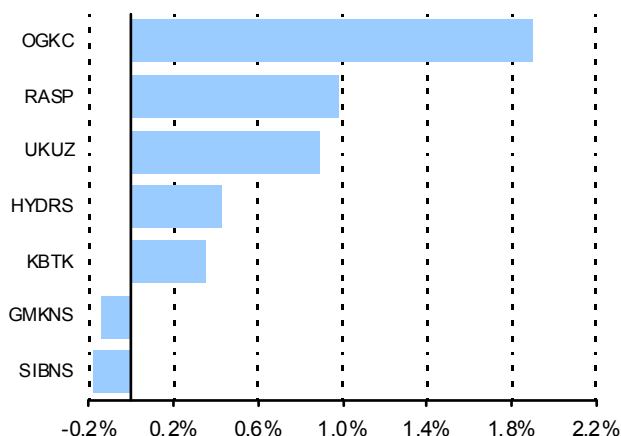
Объем торгов акц.*, млн. руб.

Индекс PTC Сибирь



* по акциям из состава Индекса PTC Сибирь

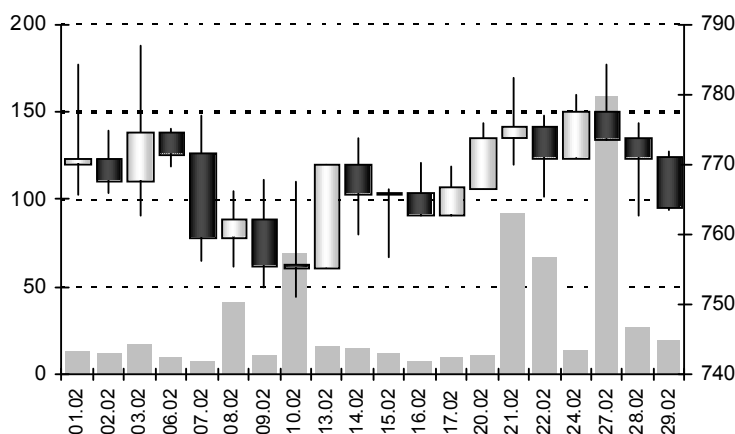
Лидеры влияния на Индекс PTC Сибирь, %



Индекс ММВБ Инновации

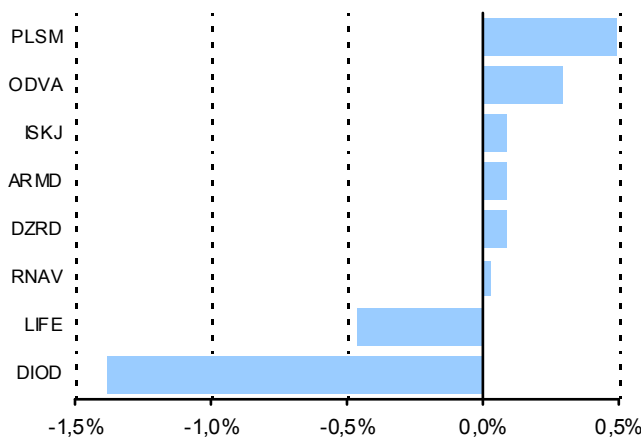
Объем торгов акц.*, млн. руб.

Индекс ММВБ Инновации

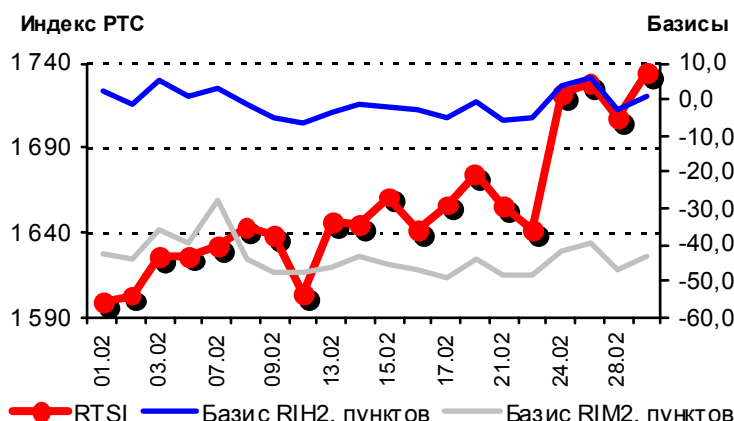


* по акциям из состава Индекса ММВБ Инновации

Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



Производные на индексы



В феврале объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 2 725,72 млрд. рублей или 27,75 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту в прошлом месяце составил 2 443,39 млрд. рублей или 24,84 млн. контрактов.

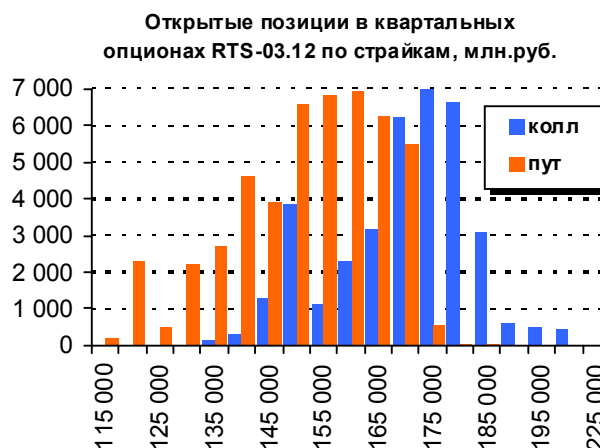
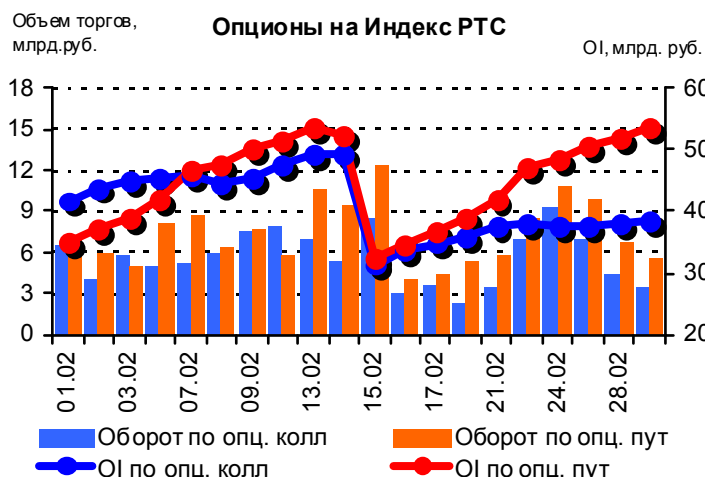
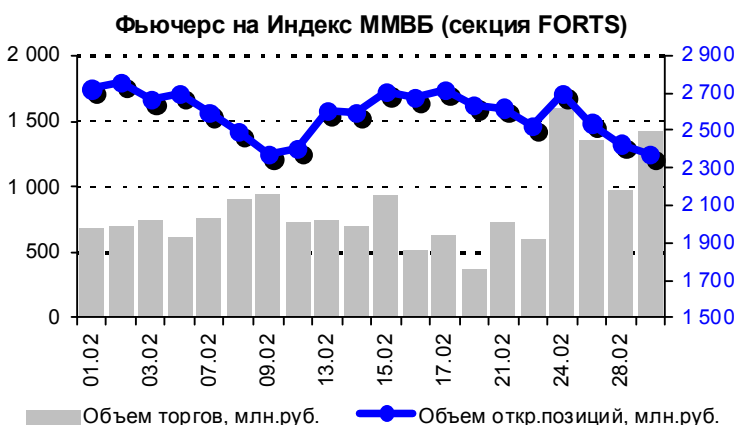
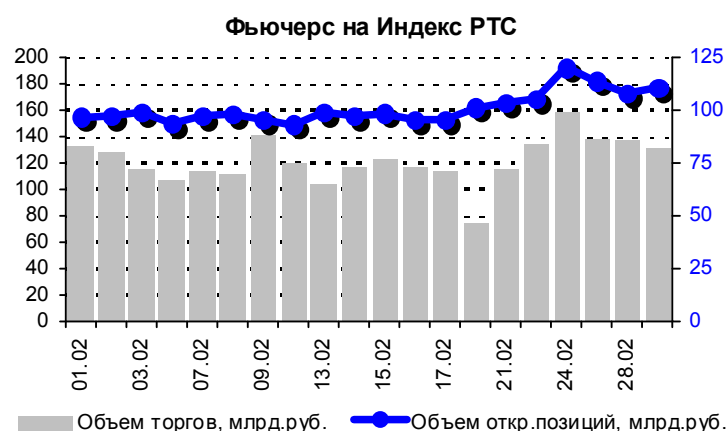
Фьючерсы на Индекс РТС в прошлом месяце торговались в бэквордации. Индекс РТС за это время прибавил в весе 10,00%, при этом мартовские фьючерсы подорожали на 10,12%, а июньские – на 9,87%.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за месяц повысился на 15,50%.

Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ, обращающимся в секции FORTS составил в прошедшем месяце 16,61 млрд. рублей или 105,9 тыс. контрактов. За прошедший месяц было отмечено уменьшение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ – на 12,74%.

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил в прошлом месяце 260,55 млрд. рублей или 2,76 млн. контрактов. Объем открытых позиций по состоянию на конец месяца составил 92,09 млрд. рублей или 1 013,61 тыс. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 41,7% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 175 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 160 000.

За прошедший месяц повышение объема открытых позиций по опционам на фьючерс на Индекс РТС составило 28,13%.



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

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

Департамент индексов и биржевой информации

Россия, 125009 г. Москва, Большой Кисловский пер., д.13

Телефоны: +7(495) 363 -3232 (доб. 26031)

Факсы: +7(495) 363 -3232 (доб. 22222)

E-mail: pr@micex.com