

Индекс	Значение 30.09.14	Изменение за период, %		
		месяц	квартал	год
Композитные индексы				
Индекс ММВБ	1 411,07	0,74%	-4,42%	-3,54%
Индекс РТС	1 123,72	-5,59%	-17,74%	-21,00%
Индекс голубых фишек	9 479,29	1,22%	-4,62%	-4,48%
Индекс второго эшелона	2 845,05	-2,31%	-6,22%	-6,08%
Индекс широкого рынка	997,26	0,73%	-4,44%	-3,63%
Отраслевые индексы (руб. значения)				
Нефть и газ	3 443,36	1,80%	-3,63%	-1,05%
Электроэнергетика	928,84	-0,82%	-5,65%	-14,48%
Потребительский сектор	6 182,25	4,91%	0,22%	7,33%
Телекоммуникации	2 092,55	-0,80%	-3,83%	-10,70%
Машиностроение	1 281,07	-7,24%	-13,20%	-32,36%
Финансы	3 625,72	-17,54%	-26,83%	-22,75%
Химия и нефтехимия	6 552,14	5,12%	-2,03%	5,19%
Металлы и добыча	2 621,26	1,38%	10,34%	21,05%
Транспорт	790,67	-8,36%	-20,30%	-36,59%
Тематические индексы				
ММВБ-10	3 110,64	2,93%	-3,83%	-0,73%
Индекс волатильности	33,26	-5,62%	10,54%	25,08%
Индекс ММВБ Инновации	242,50	-4,29%	-24,41%	-40,36%
Индекс РТС Сибирь	447,09	0,78%	0,68%	-4,31%
Курс доллара (ЦБ РФ)				
USD / RUB	39,39	8,49%	17,12%	21,77%

В сентябре 2014г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику по индексу ММВБ Московской Биржи. Индекс ММВБ повысился на 0,74% до 1 411,07 пунктов (1 400,71 пунктов на 29 августа 2014г.), долларовой Индекс РТС упал на 5,59% до 1 123,72 пунктов (1 190,23 пунктов на 29 августа 2014г.).

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедший месяц вырос на 8,49%.

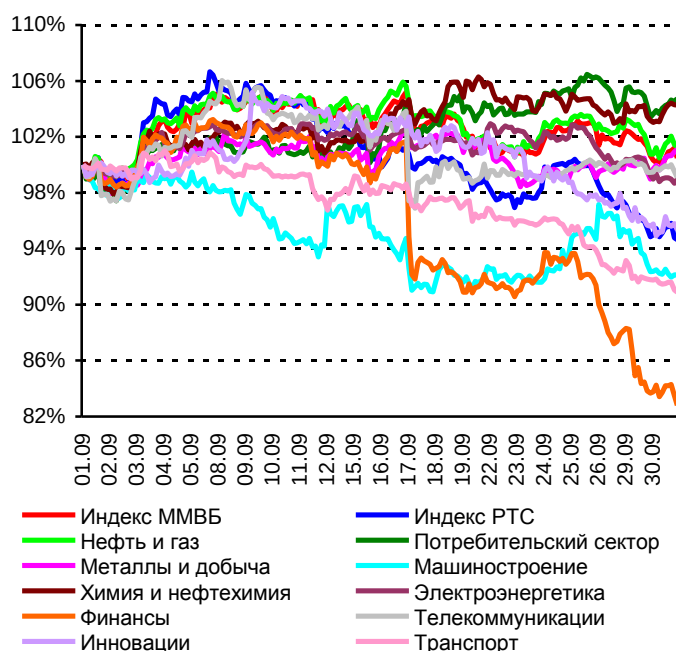
На фондовом рынке наблюдалось понижение волатильности: Российский индекс волатильности понизился на 5,62% до 33,26 пункта (35,24 пункта на 29 августа 2014г.).

В прошедшем месяце часть ключевых секторов экономики, представленных на российском фондовом рынке, показала положительную динамику. Лидером роста стал нефтехимический сектор: повышение по отраслевому индексу составило 5,12%. Также существенное увеличение продемонстрировали потребительский и нефтегазовый секторы – Индекс потребительского сектора вырос на 4,91%, а Индекс нефти и газа прибавил в весе 1,80%. Наибольшее падение было отмечено в финансовом секторе – Индекс финансов понизился на 17,54%.

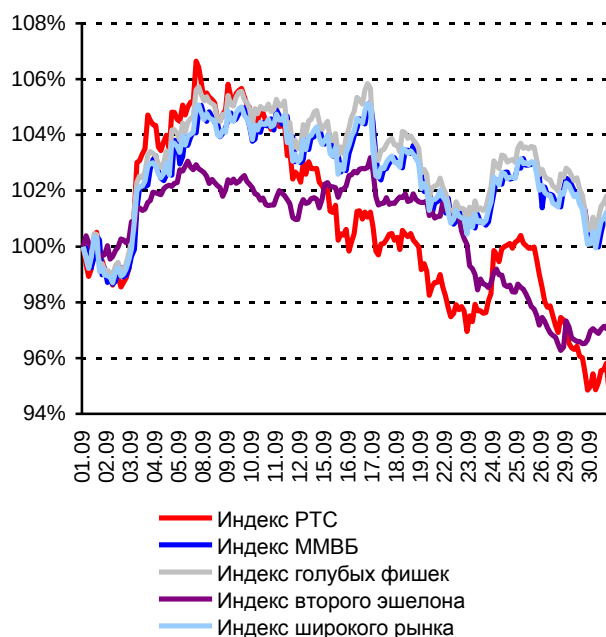
Индекс голубых фишек вырос на 1,22% до 9 479,29 пунктов (9 364,82 пунктов на 29 августа 2014г.).

Индекс второго эшелона упал на 2,31% до 2 845,05 пунктов (2 912,22 пунктов на 29 августа 2014г.). Индекс широкого рынка прибавил в весе 0,73% и составил 997,26 пунктов (989,99 пунктов на 29 августа 2014г.).

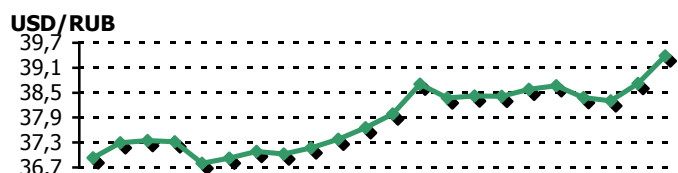
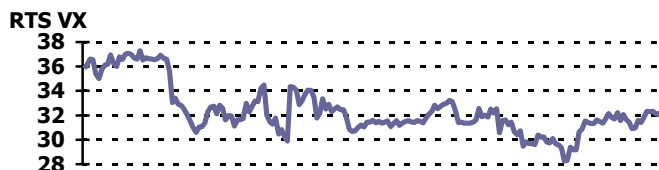
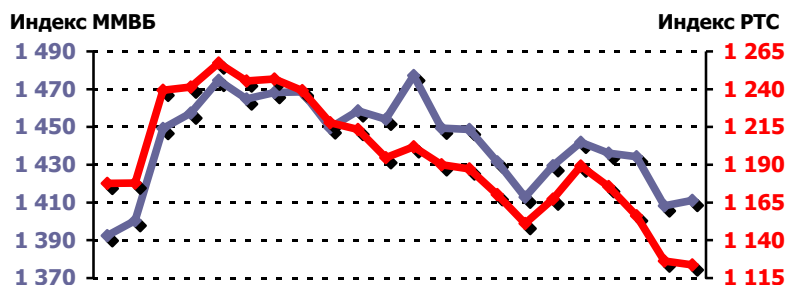
КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



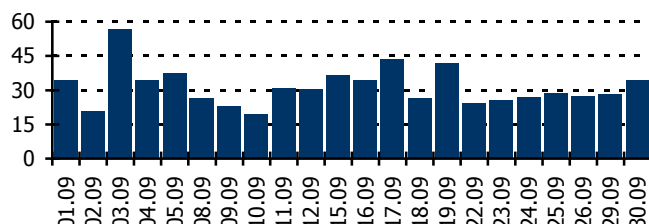
КОМПОЗИТНЫЕ ИНДЕКСЫ



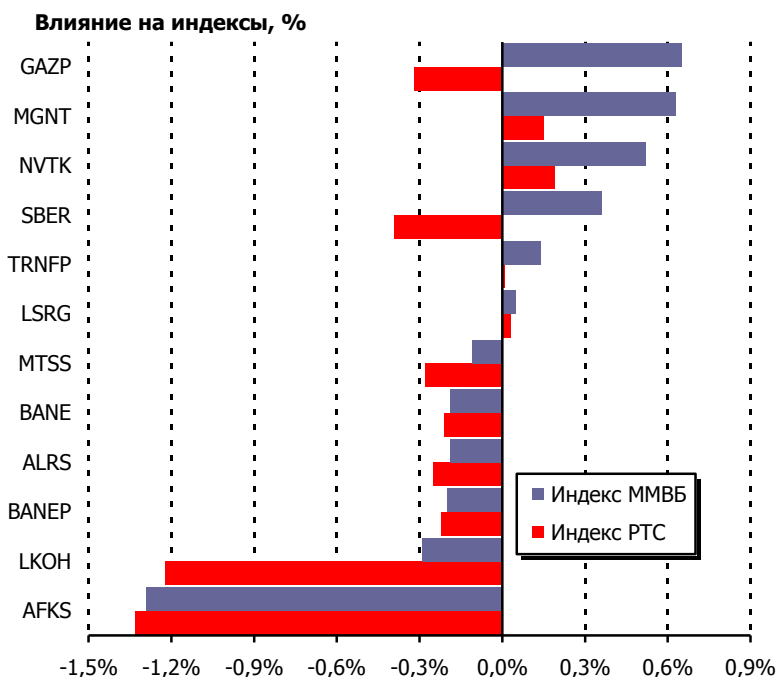
Основные индексы Московской Биржи – ММВБ и РТС



Объем торгов (осн)*, млрд.руб.



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



Влияние на индекс	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Индекс ММВБ	+3,32%	-2,58%	0	+0,74%
Индекс РТС	+0,51%	-6,10%	0	-5,59%

В сентябре 2014г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику по индексу ММВБ Московской Биржи. Индекс ММВБ повысился на 0,74% до 1 411,07 пунктов (1 400,71 пунктов на 29 августа 2014г.), долларовый Индекс РТС упал на 5,59% до 1 123,72 пунктов (1 190,23 пунктов на 29 августа 2014г.).

По состоянию на конец месяца Индекс ММВБ находился на 3,54% ниже закрытия год назад (1 462,82 пунктов на 30 сентября 2013г.), Индекс РТС был на 21,00% ниже аналогичного показателя год назад (1 422,49 пунктов на 30 сентября 2013г.).

Понижение Индекса РТС в прошедшем месяце сопровождалось понижением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX понизился на 5,62%.

Объем торгов ценными бумагами, включенными в Базу расчета индексов Московской Биржи, составил 692,46 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в состав индексов, на конец месяца составила 20 724,27 млрд. руб.

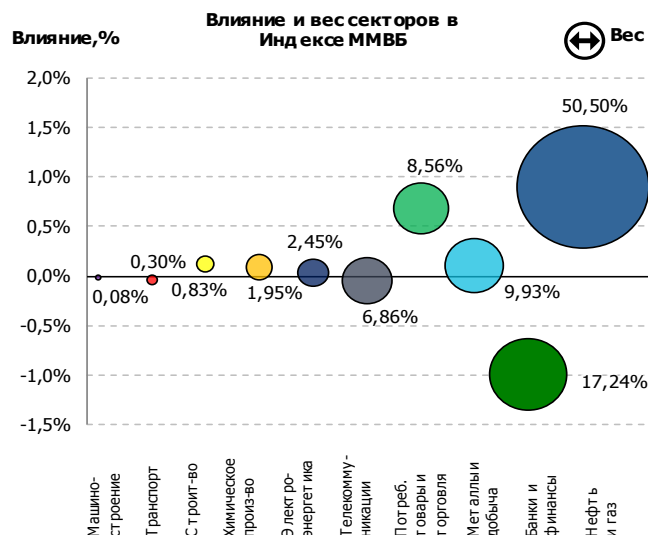
По итогам месяца 34 из 52 акций, входящих в старую и новую Базу расчета Индекса ММВБ, оказали на его динамику положительное воздействие (+3,32%), 18 ценных бумаг повлияли отрицательно (-2,58%).

Наибольший вклад в рост Индекса ММВБ по итогам месяца внесли ценные бумаги нефти и газа (+0,91%) и потребительского сектора (+0,69%).

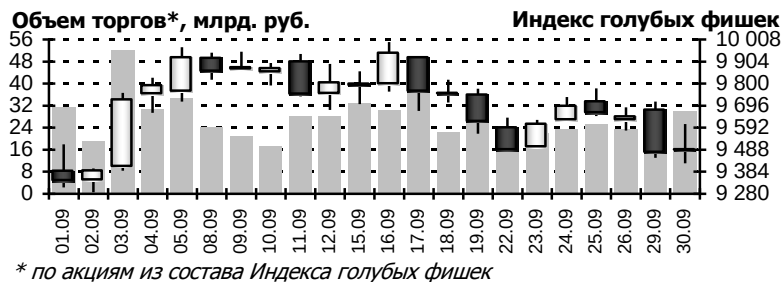
Наибольшее позитивное влияние на Индекс ММВБ оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО "Газпром" (+0,65%), ОАО "Магнит" (+0,63%) и ОАО "НОВАТЭК" (+0,52%). Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало понижение цен на обыкновенные акции ОАО АФК "Система" (-1,29%) и ОАО "ЛУКОЙЛ" (-0,29%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс РТС оказало понижение цен на обыкновенные акции ОАО АФК "Система" (-1,33%), ОАО "ЛУКОЙЛ" (-1,22%) и ОАО "Сбербанк России" (-0,39%). Наибольшее позитивное влияние на Индекс РТС оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО "НОВАТЭК" (+0,19%) и ОАО "Магнит" (+0,15%).

На нефтегазовый сектор приходится 50,50% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 17,24%) и металлургия (9,93%).



Индекс голубых фишек



В сентябре Индекс голубых фишек продемонстрировал положительную динамику.

Индекс голубых фишек повысился на 1,22% до 9 479,29 пунктов (9 364,82 пунктов на 29 августа 2014г.). По состоянию на конец месяца Индекс голубых фишек был на 4,48% ниже своего закрытия год назад (9 923,83 пунктов на 30 сентября 2013г.).

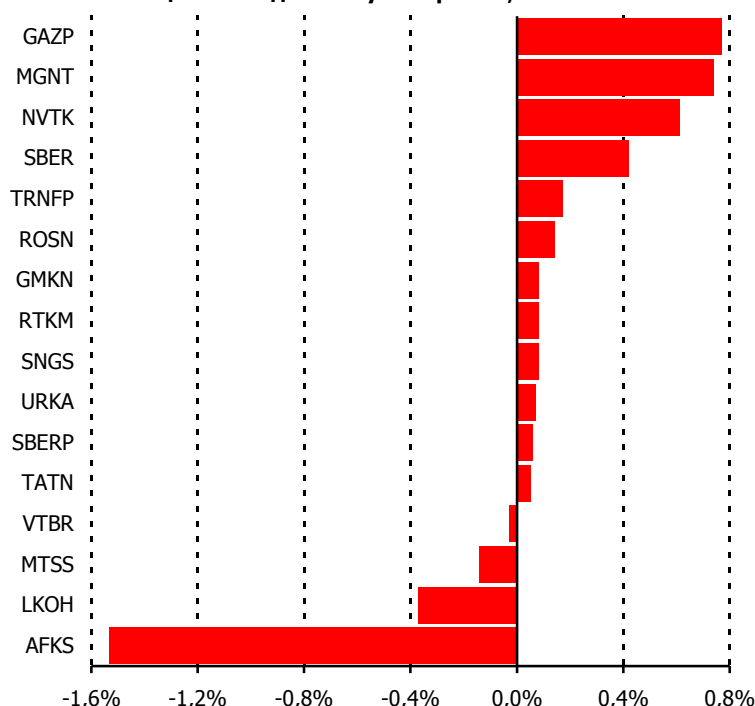
По итогам месяца 13 из 17 ценных бумаг, входящих в старую и новую Базу расчета Индекса голубых фишек, оказали на его динамику положительное воздействие (+3,29%), 4 акции повлияли отрицательно (-2,07%).

Наибольшее позитивное влияние на динамику Индекса голубых фишек оказали обыкновенные акции ОАО "Газпром" (+0,77%), ОАО "Магнит" (+0,74%) и ОАО "НОВАТЭК" (+0,61%).

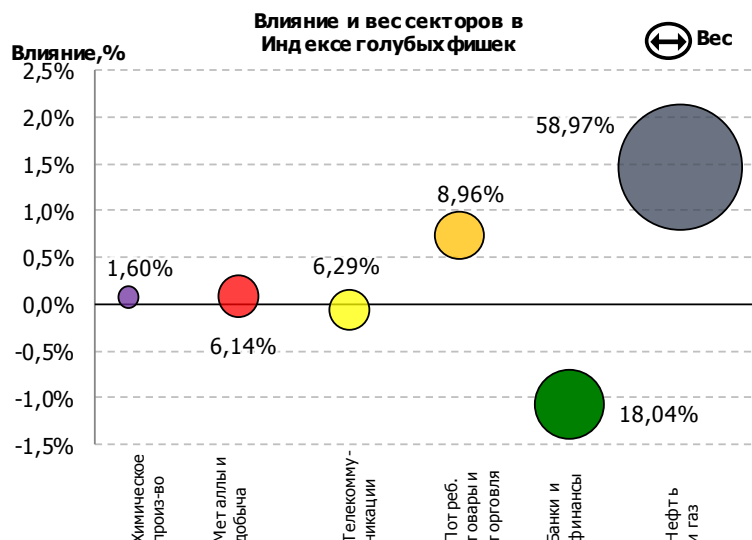
Наиболее негативно на динамике Индекса голубых фишек отразилось падение цен обыкновенных акций ОАО АФК "Система", влияние которых составило (-1,53%) и ОАО "ЛУКОЙЛ" (-0,37%).

На нефтегазовый сектор приходится 58,97% суммарной капитализации индекса голубых фишек. Среди остальных отраслей выделяются финансовый (вес в индексе 18,04%) и потребительский секторы (8,96%)

Влияние акций на Индекс голубых фишек, %



Изменение цены за месяц	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Количество бумаг	13	4	0	17
Влияние, %	+3,29%	-2,07%	0	+1,22%

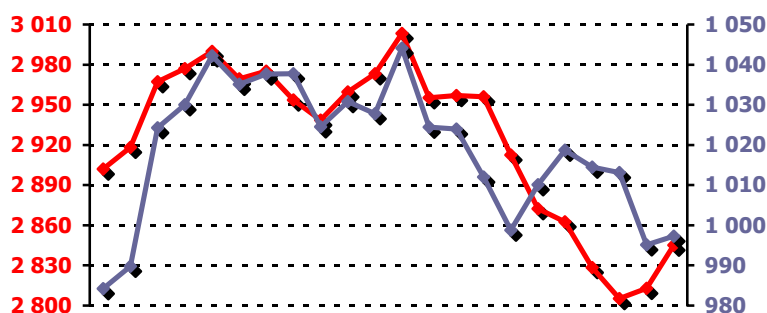


Код	Наименование	Вес в Индексе голубых фишек	Вес в Индексе ММВБ
AFKS	АФК Система, ао	0,81%	0,68%
GAZP	Газпром, ао	18,46%	15,54%
GMKN	ГМК Норильский никель, ао	6,14%	5,17%
LKOH	ЛУКОЙЛ, ао	17,27%	14,54%
MGNT	Магнит, ао	8,96%	7,54%
MTSS	МТС, ао	4,91%	4,13%
NVTK	НОВАТЭК, ао	5,93%	4,99%
ROSN	Роснефть, ао	5,22%	4,39%
RTKM	Ростелеком, ао	1,39%	1,17%
SBER	Сбербанк России, ао	13,84%	11,64%
SNGS	Сургутнефтегаз, ао	4,11%	3,46%
SNGSP	Сургутнефтегаз, ап	2,71%	2,28%
TATN	Татнефть им.В.Д.Шашина, ао	2,86%	2,41%
TRNFP	АК Транснефть, ап	2,40%	2,02%
URKA	Уралкалий, ао	1,60%	1,34%
VTBR	Банк ВТБ, ао	3,40%	2,86%
Всего		100,00%	84,15%

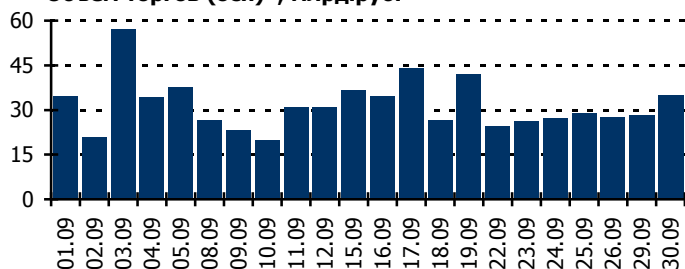
Индексы широкого рынка и второго эшелона

Индекс второго эшелона

Индекс широкого рынка

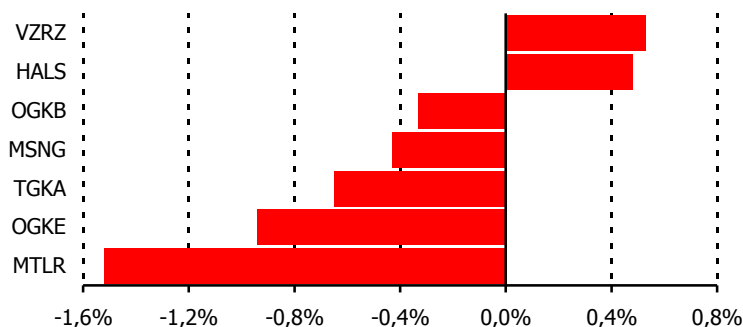


Объем торгов (осн)*, млрд.руб.

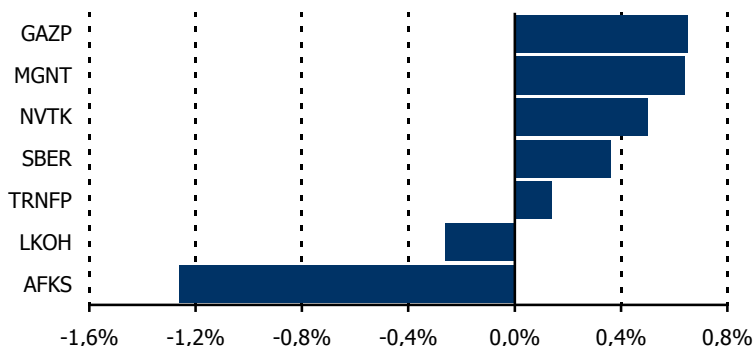


* по акциям из состава Индекса широкого рынка

Влияние акций на Индекс второго эшелона, %



Влияние акций на Индекс широкого рынка, %



Изменение цены за месяц	Рост	Снижение	Итоговое влияние, %
Индекс второго эшелона	+3,21%	-5,52%	-2,31%
Индекс широкого рынка	+3,32%	-2,59%	+0,73%

В сентябре Индекс второго эшелона упал на 2,31% до 2 845,05 пунктов (2 912,22 пунктов на 29 августа 2014г.). Индекс широкого рынка прибавил в весе 0,73% и составил 997,26 пунктов (989,99 пунктов на 29 августа 2014г.).

По состоянию на конец месяца Индекс второго эшелона был на 6,08% ниже своего закрытия год назад (3 029,34 пунктов на 30 сентября 2013г.). Индекс широкого рынка был на 3,63% ниже своего закрытия год назад (1 034,78 пунктов на 30 сентября 2013г.).

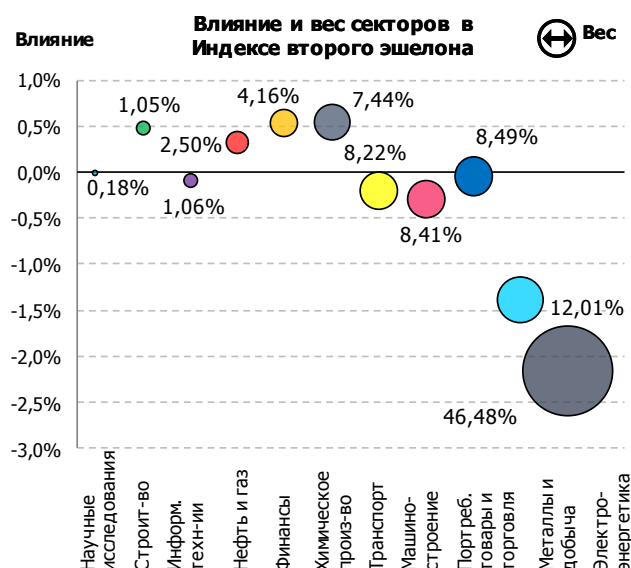
По итогам месяца 31 из 52 ценных бумаг, входящих в старую и новую Базу расчета Индекса второго эшелона, оказала на его динамику отрицательное воздействие (-5,52%), 21 акция повлияла положительно (+3,21%).

Наиболее негативно на динамике Индекса второго эшелона отразилось падение цен обыкновенных акций ОАО "Мечел" (-1,52%) и ОАО "Энел ОГК-5" (-0,94%).

Наиболее позитивное влияние на динамику Индекса широкого рынка оказали обыкновенные акции ОАО "Газпром" (+0,65%) и ОАО "Магнит" (+0,64%).

Наибольший вклад в падение Индекса второго эшелона по итогам месяца внесли ценные бумаги электроэнергетики (-2,16%) и металлов и добычи (-1,39%).

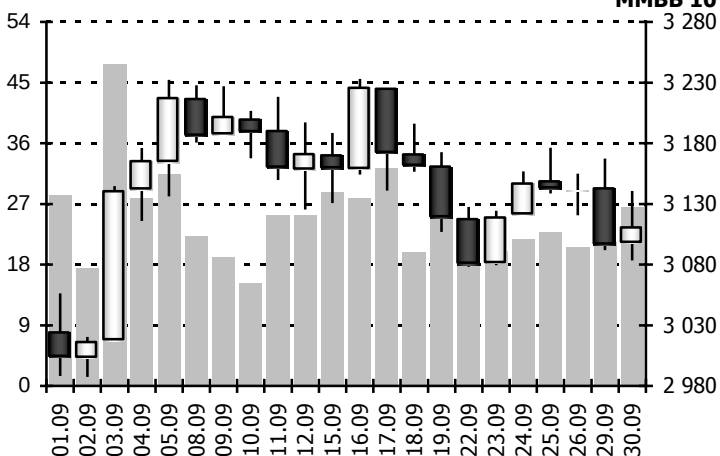
На электроэнергетику приходится 46,48% суммарной капитализации Индекса второго эшелона. Среди остальных отраслей выделяются металлы и добыча (вес в индексе 12,01%) и потребительский сектор (8,49%).



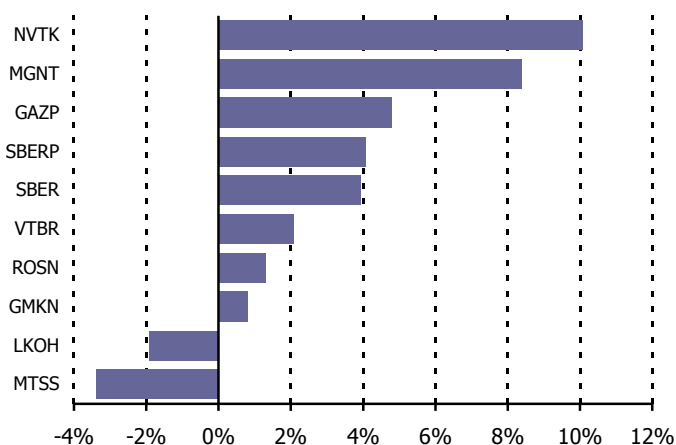
Индекс ММВБ 10

Объем торгов акц.*, млрд. руб.

Индекс
ММВБ 10



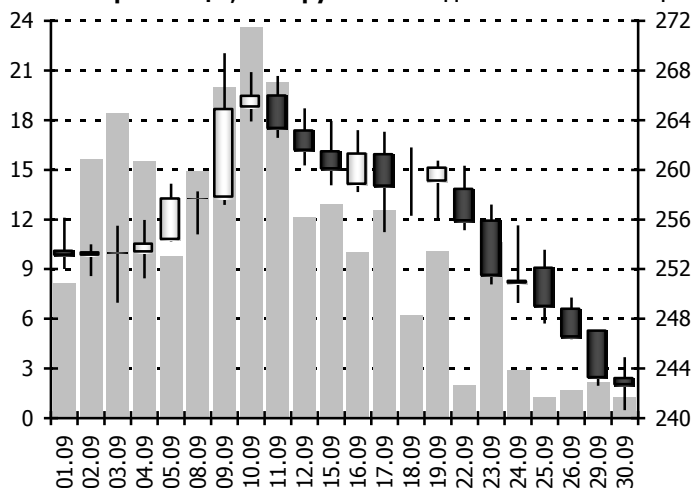
Прирост цен акций в Индексе ММВБ 10, %



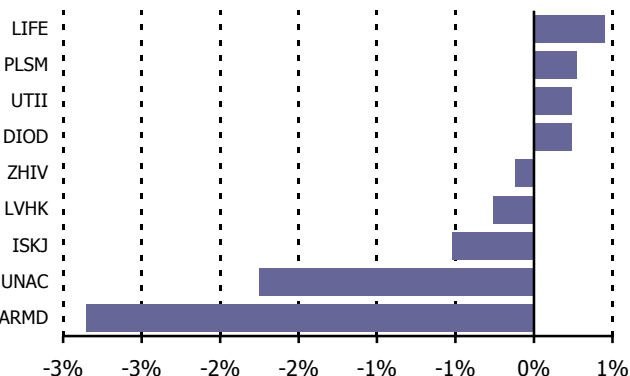
Индекс ММВБ Инновации

Объем торгов акц.*, млн. руб.

Индекс ММВБ Инновации



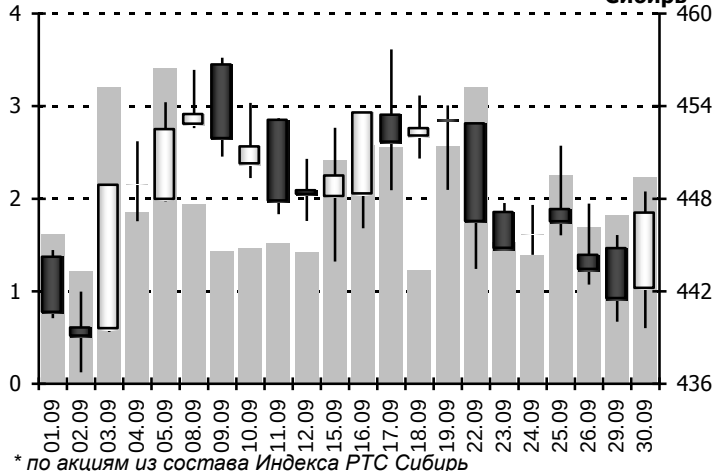
Лидеры влияния на Индекс
ММВБ Инновации, %



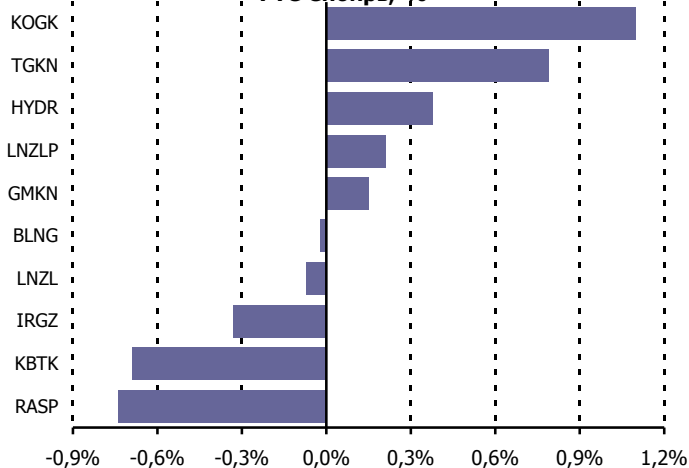
Индекс РТС Сибирь

Объем торгов акц.*, млрд. руб.

Индекс РТС
Сибирь



Лидеры влияния на Индекс
РТС Сибирь, %



Долговой рынок

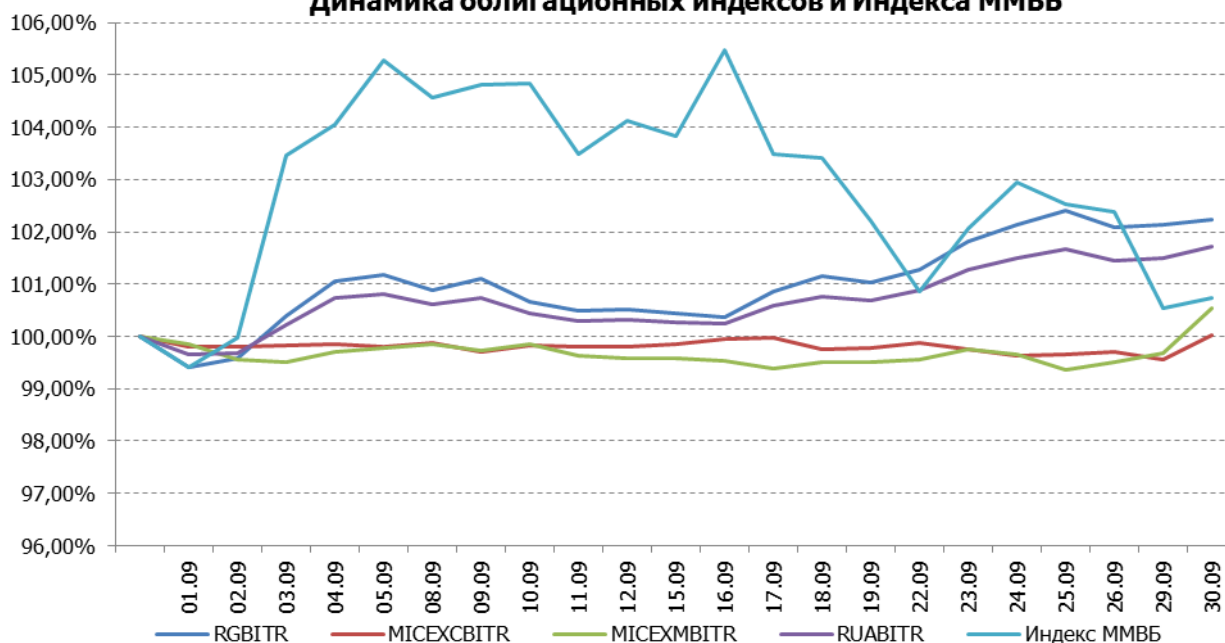
Индекс	Значение 30.09.2014	YTM, % 30.09.2014	Изменение за период, %		
			Месяц	Квартал	Год
Композитный индекс облигаций					
RUABITR	126,94	9,48	1,72%	-0,84%	0,97%
Индексы государственных облигаций					
RGBITR	320,74	9,24	2,24%	-1,25%	-0,61%
RUGBITR3Y	323,16	9,00	1,40%	0,79%	3,40%
RUGBITR5Y	323,92	9,24	2,61%	-1,36%	-0,24%
RUGBITR5+	332,37	9,41	2,56%	-3,10%	-3,81%
Индексы корпоративных облигаций					
MICEXCBITR	248,97	10,55	0,02%	0,38%	4,03%
MICEXCBITR3Y	248,84	10,47	0,24%	0,74%	4,70%
MICEXCBITR5Y	273,59	11,41	-2,20%	-2,33%	0,02%
Сектор BBB					
RUCBITRBBB	252,63	10,10	0,33%	0,61%	4,13%
RUCBITRBBB3Y	251,62	10,07	0,47%	0,95%	5,05%
RUCBITRBBB5Y	281,65	10,34	-1,24%	-1,53%	0,23%
RUCBITRBBB3+	283,28	10,34	-1,24%	-1,53%	0,13%
Сектор BB					
RUCBITRBB	259,81	11,29	-0,42%	-0,25%	4,33%
RUCBITRBB3Y	257,86	11,27	-0,41%	0,05%	5,08%
RUCBITRBB3+	296,83	11,48	-0,44%	-1,71%	1,77%
Сектор B					
RUCBITRB	259,07	12,31	-0,40%	1,27%	5,13%
RUCBITRB3Y	261,73	11,79	0,55%	1,63%	5,94%
Индексы муниципальных облигаций					
MICEXMBITR	183,93	9,45	0,55%	1,12%	4,23%
RUMBITR3Y	195,22	9,27	0,42%	1,60%	6,13%
RUMBITRBBB	193,28	8,53	0,88%	1,89%	5,84%
RUMBITRBBB3Y	193,87	7,96	0,66%	2,00%	6,92%
RUMBITRBBB3+	193,60	9,91	1,41%	1,91%	4,77%
RUMBITRBB	195,16	10,71	0,08%	0,94%	4,71%
RUMBITRBB3Y	197,66	10,69	0,17%	1,08%	5,31%

Агрегированный индекс облигаций RUABITR, рассчитанный по методике совокупного дохода и включающий в себя ОФЗ, корпоративные, субфедеральные и муниципальные облигации, за сентябрь вырос на 1,72%.

Индекс государственных облигаций России, RGBITR, вырос за прошедший месяц на 2,24% и составил 320,74 пунктов. При этом средневзвешенная доходность к погашению облигаций, входящих в базу расчета индекса, составила на конец месяца 9,24%. Наибольший рост среди индексов государственных бумаг, сегментированных по дюрации, показал RUGBITR5Y, включающий в себя ОФЗ с дюрацией от 3 до 5 лет. Его рост за месяц составил 2,61%.

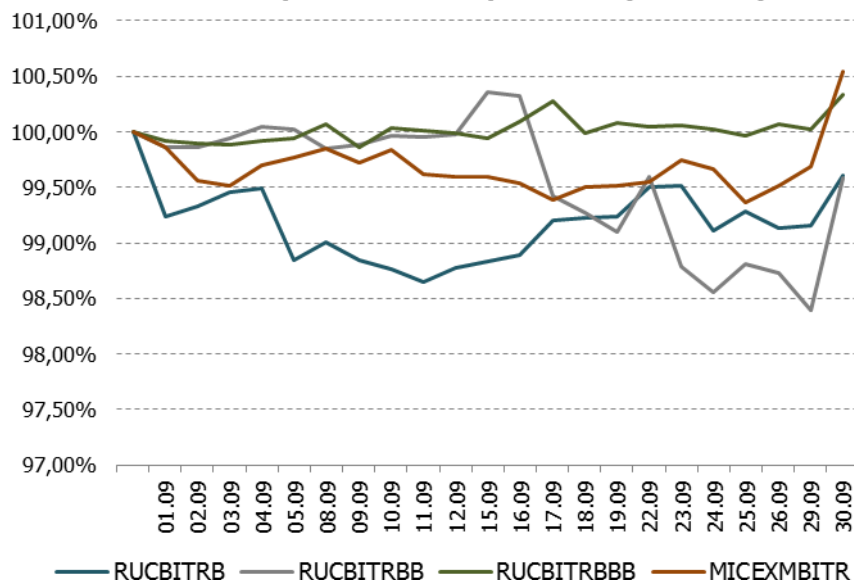
Индекс субфедеральных и муниципальных облигаций MICEXMBITR за прошедший месяц вырос на 0,55% и составил 183,93 пункта. Наибольший прирост среди индексов муниципальных облигаций, сегментированных по дюрации и кредитному качеству, показал индекс RUMBITRBBB3+, включающий в себя облигации с дюрацией более 3х лет и уровнем кредитного рейтинга от BBB- до BBB+. Его прирост за сентябрь составил 1,41%.

Динамика облигационных индексов и Индекса ММВБ



Долговой рынок

Динамика индексов корпоративных облигаций, сегментированных по кредитному качеству



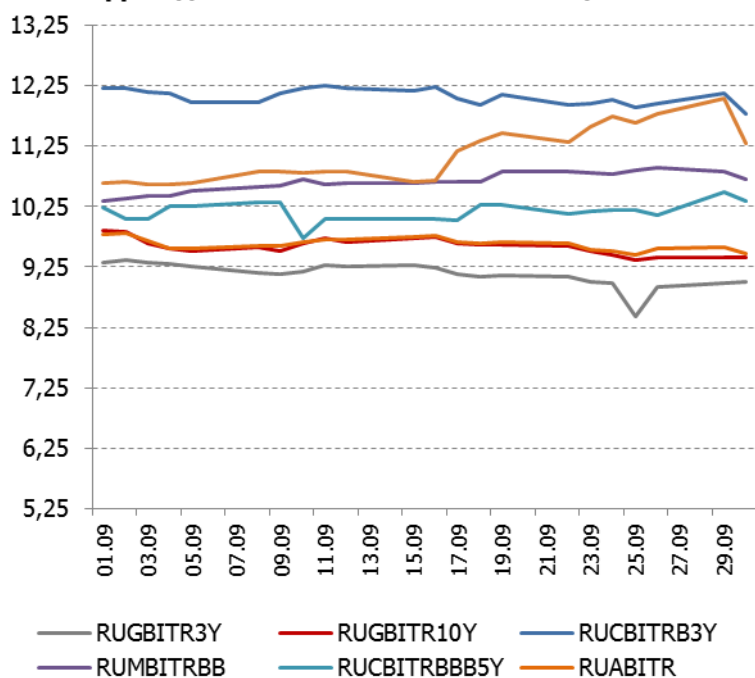
В секторе корпоративных облигаций индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, MICEXCBITR вырос на 0,02% и составил 248,97 пунктов. Средневзвешенная доходность к погашению индекса MICEXCBITR составила на конец месяца 10,55%, спрэд к доходности индекса гос. бумаг RGBITR 131 базисный пункт.

Среди индексов корпоративных облигаций наибольший прирост показал индекс, RUCBITRB3Y, который вырос на 0,55%. В базу расчета индекса включены облигации с дюрацией от 1 года до 3х лет и кредитным качеством от B- до B+.

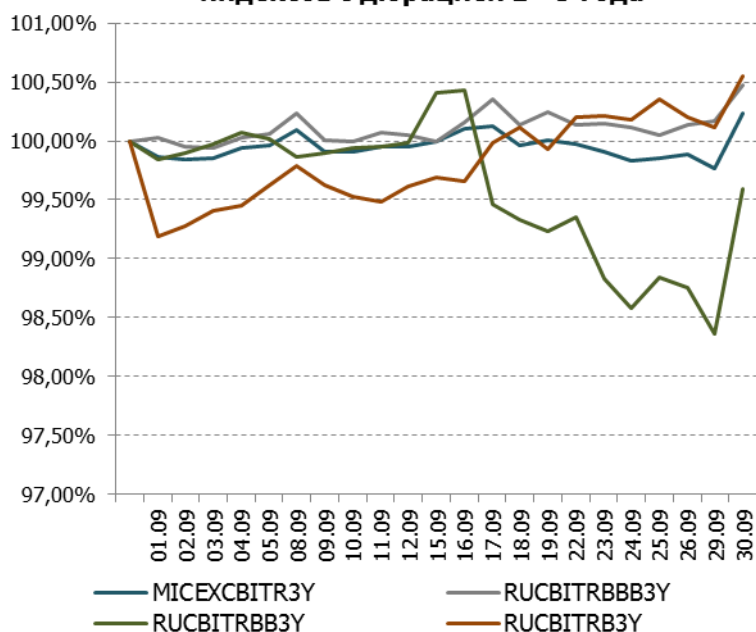
Индекс корпоративных бумаг высокого кредитного качества RUCBITRBBB вырос за прошедший месяц на 0,33%. Индекс корпоративных бумаг сектора BB (RUCBITRBB) снизился на 0,42%, а индекс сектора B (RUCBITRB) показал снижение на 0,40%.

Наибольшую средневзвешенную доходность к погашению/оферте по состоянию на 30.09.2014 продемонстрировал индекс RUCBITRB, она составила 12,31%.

Доходность к погашению облигационных



Динамика облигационных индексов с дюрацией 1 - 3 года

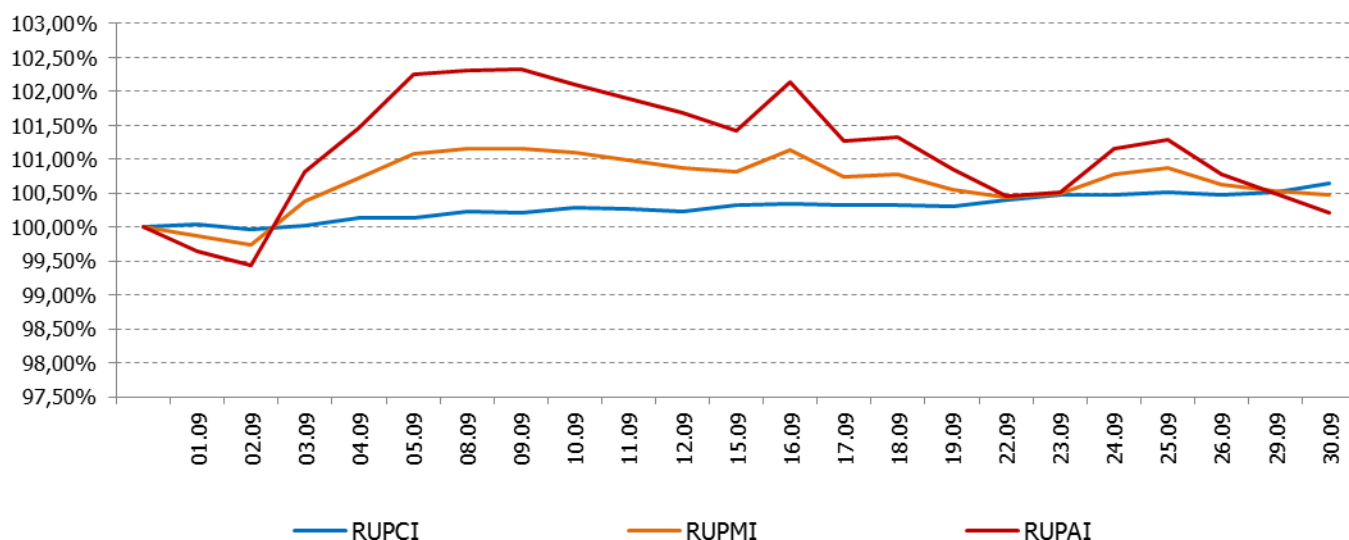


Долговой рынок

Индекс	Значение 30.09.2014	Изменение за период, %		
		Месяц	Квартал	Год
Индексы активов пенсионных накоплений				
Консервативный	1670,99	0,65%	1,22%	4,60%
Сбалансированный	1437,98	0,47%	0,56%	3,40%
Агрессивный	1214,35	0,22%	-0,22%	1,70%

Консервативная стратегия вложения средств по индексам пенсионных накоплений обеспечила бы рост на уровне 0,65% за месяц. Агрессивная стратегия показала рост на 0,22% за месяц. Сбалансированный индекс показал прирост на уровне 0,47%.

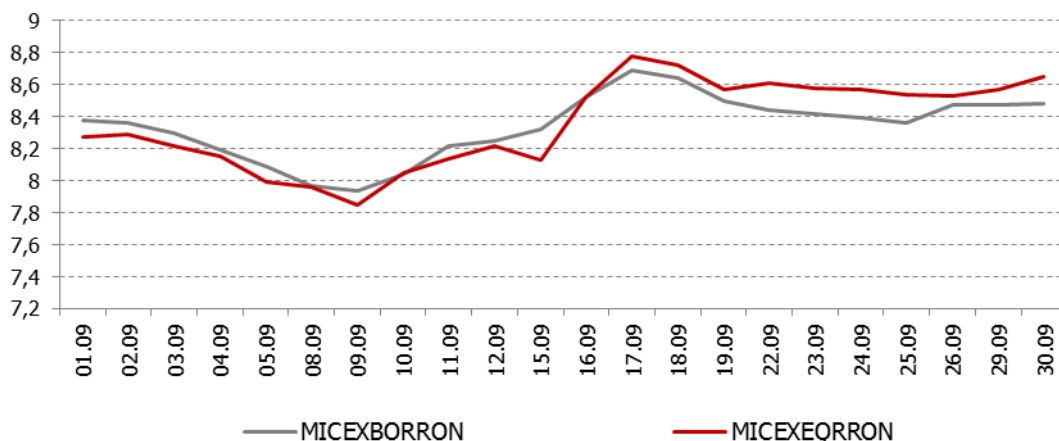
Динамика индексов активов пенсионных накоплений



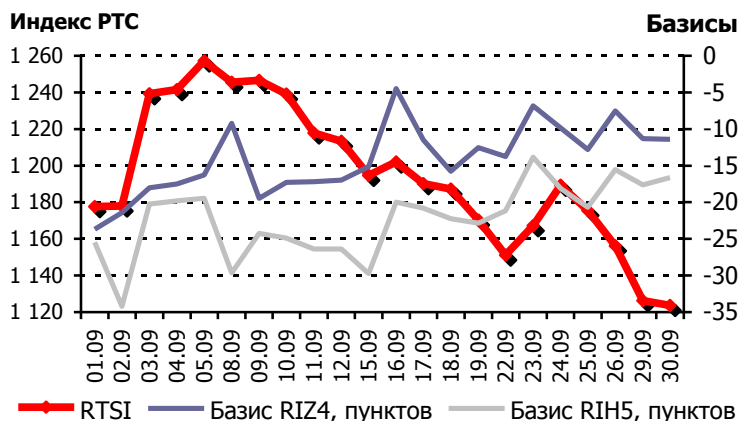
Индикатор ставок РЕПО овернайт по облигациям за прошедший месяц изменился с 8,34% до 8,48% (рост на 14 базисных пунктов). Индикатор ставки РЕПО овернайт по акциям составил 8,65%.

Индикатор	Значение 30.09.2014	Изменение за период, б.п		
		Месяц	Квартал	Год
Индикаторы ставок РЕПО по облигациям				
Овернайт	8,48	14	29	217
1 неделя	8,44	-55	-36	213
2 недели	9,06	4	48	214
Индикаторы ставок РЕПО по акциям				
Овернайт	8,65	30	36	229
1 неделя	9,46	-104	181	405
2 недели	9,90	0	40	310

Динамика индикаторов ставок РЕПО овернайт



Производные на индексы



В сентябре объем торгов производными инструментами на индексы на Московской Бирже составил 2 071,25 млрд. рублей или 22,77 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту в прошлом месяце составил 1 810,67 млрд. рублей или 19,96 млн. контрактов.

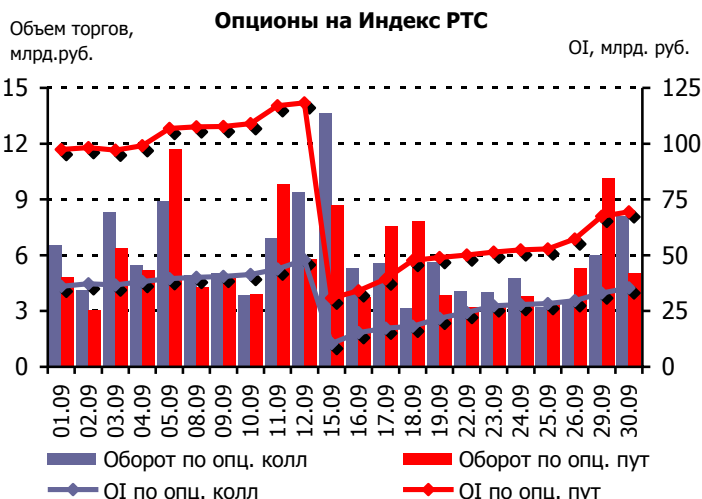
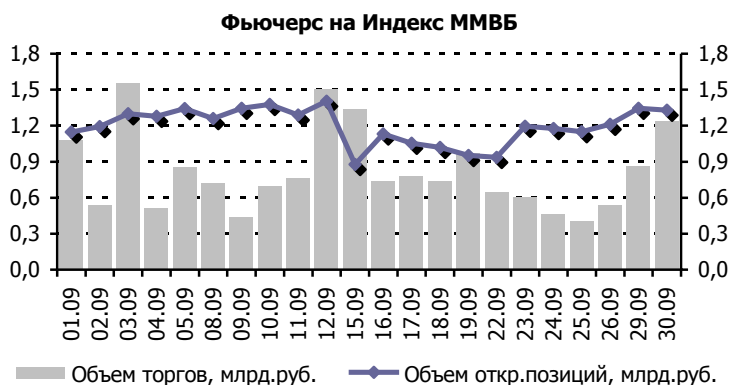
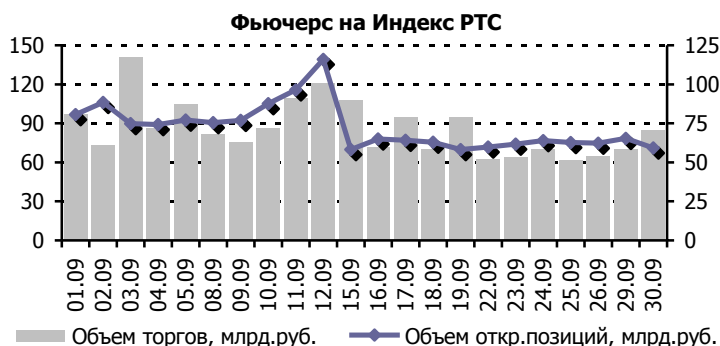
Фьючерсы на Индекс РТС в прошлом месяце торговались в бэквордации. Индекс РТС за это время потерял в весе 5,59%, при этом декабрьские и мартовские фьючерсы подешевели на 5,07% и на 5,08% соответственно. 15 сентября произошло исполнение сентябрьских контрактов на Индекс РТС. Цена исполнения составила 119 204 пунктов.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за месяц упал на 26,36%.

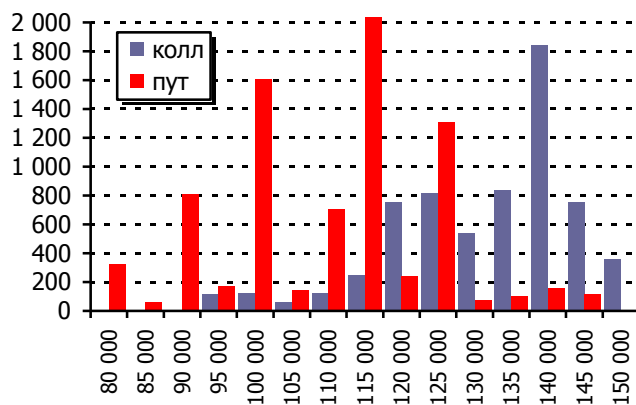
Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ составил в прошедшем месяце 16,75 млрд. рублей или 115,50 тыс. контрактов. За прошедший месяц было отмечено увеличение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ – на 9,77%.

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил в прошлом месяце 242,89 млрд. рублей или 2,69 млн. контрактов. Объем открытых позиций по состоянию на конец месяца составил 104,82 млрд. рублей или 1,15 млн. контрактов. При этом на долю опционов пут приходилось 66,28% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 140 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 115 000.

За прошедший месяц уменьшение объема открытых позиций по опционам на фьючерс на Индекс РТС составило 21,46%.



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-12.14 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 – ценовые взвешенные по рыночной капитализации индексы наиболее ликвидных акций российских эмитентов, экономическая деятельность которых относится к соответствующим секторам экономики, допущенных к обращению на Бирже и включенных в базу расчета индекса Широкого рынка. Методикой предусмотрен расчет индексов по девяти отраслям экономики:

- 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
- MICEX TRN (RTStn) – индекс акций транспортных компаний

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, находящейся 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 – индексы корпоративных, государственных и муниципальных облигаций, сегментированных по дюрации и кредитному качеству облигаций, включенных в базы расчета. Облигационные индексы рассчитываются одновременно по методикам «total return» и «clean 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: index@moex.com

Настоящий документ был подготовлен и выпущен Открытым акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – «Компания»). Если нет какой-либо оговорки об ином, то Компания считается источником всей информации, изложенной в настоящем документе. Данная информация предоставляется по состоянию на дату настоящего документа и может быть изменена без какого-либо уведомления.

Данный документ не является, не формирует и не должен рассматриваться в качестве предложения или же приглашения для продажи или участия в подписке, или же, как побуждение к приобретению или же к подписке на какие-либо ценные бумаги, а также этот документ или его часть или же факт его распространения не являются основанием и на них нельзя полагаться в связи с каким-либо предложением, договором, обязательством или же инвестиционным решением, связанными с ним, равно как и он не является рекомендацией относительно ценных бумаг компании.

Изложенная в данном документе информация не являлась предметом независимой проверки. В нем также не содержится каких-либо заверений или гарантий, сформулированных или подразумеваемых и никто не должен полагаться на достоверность, точность и полноту информации или мнения, изложенного здесь. Никто из Компании или каких-либо ее дочерних обществ или аффилированных лиц или их директоров, сотрудников или работников, консультантов или их представителей не принимает какой-либо ответственности (независимо от того, возникла ли она в результате халатности или чего-то другого), прямо или косвенно связанной с использованием этого документа или иным образом возникшей из него.

Данный документ содержит прогнозные заявления. Все включенные в настоящий документ заявления, за исключением заявлений об исторических фактах, включая, но, не ограничиваясь, заявлениями, относящимися к нашему финансовому положению, бизнес-стратегии, планам менеджмента и целям по будущим операциям являются прогнозными заявлениями. Эти прогнозные заявления включают в себя известные и неизвестные риски, факторы неопределенности и иные факторы, которые могут стать причиной того, что наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, будут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются под этими прогнозными заявлениями. Данные прогнозные заявления основаны на многочисленных презумпциях относительно нашей нынешней и будущей бизнес-стратегии и среды, в которой мы ожидаем осуществлять свою деятельность в будущем. Важнейшими факторами, которые могут повлиять на наши нынешние показатели, достижения, свершения или же производственные показатели, которые могут существенно отличаться от тех, которые сформулированы или подразумеваются этими прогнозными заявлениями являются, помимо иных факторов, следующие:

- восприятие рыночных услуг, предоставляемых Компанией и ее дочерними обществами;
- волатильность (а) Российской экономики и рынка ценных бумаг и (b) секторов с высоким уровнем конкуренции, в которых Компания и ее дочерние общества осуществляют свою деятельность;
- изменения в (а) отечественном и международном законодательстве и налоговом регулировании и (b) государственных программах, относящихся к финансовым рынкам и рынкам ценных бумаг;
- ростом уровня конкуренции со стороны новых игроков на рынке России;
- способность успевать за быстрыми изменениями в научно-технической среде, включая способность использовать расширенные функциональные возможности, которые популярны среди клиентов Компании и ее дочерних обществ;
- способность сохранять преемственность процесса внедрения новых конкурентных продуктов и услуг, равно как и поддержка конкурентоспособности;
- способность привлекать новых клиентов на отечественный рынок и в зарубежных юрисдикциях;
- способность увеличивать предложение продукции в зарубежных юрисдикциях.

Прогнозные заявления делаются только на дату настоящего документа, и мы точно отрицаем наличие любых обязательств по обновлению или пересмотру прогнозных заявлений в настоящем документе в связи с изменениями наших ожиданий, или перемен в условиях или обстоятельствах, на которых основаны эти прогнозные заявления.