

Индекс	Значение 03.08.12	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 421,28	1,07%	-1,12%	-1,49%	-14,14%
Индекс РТС	1 398,33	1,12%	-0,72%	-10,37%	-26,47%
Индекс RTS Standard	9 697,91	0,84%	-1,91%	-2,73%	-13,40%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	3 010,59	1,02%	-0,51%	-0,78%	-2,97%
Электроэнергетика	1 758,84	-0,51%	-0,60%	-11,87%	-36,24%
Потребительский сектор	4 724,51	1,80%	3,39%	-2,39%	-10,75%
Телекоммуникации	2 117,72	1,24%	1,54%	-2,22%	-16,75%
Машиностроение	1 808,16	-1,62%	-4,62%	-12,01%	-21,97%
Финансы	4 828,79	1,69%	-2,80%	-4,36%	-17,56%
Химия и нефтехимия	7 784,78	-1,40%	2,71%	4,23%	5,64%
Металлы и добыча	2 787,19	2,02%	-3,48%	-8,89%	-43,10%
Капитализационные индексы					
Высокая кап-я	2 272,27	0,96%	-1,60%	-1,31%	-14,70%
Стандартная кап-я	2 406,14	1,09%	1,64%	-1,50%	-18,78%
Базовая кап-я	3 282,67	0,28%	-0,05%	-9,70%	-32,69%
Тематические индексы					
Индекс волатильности	30,80	0,39%	-6,44%	5,77%	22,76%
Индекс РТС Сибирь	675,07	-1,75%	-0,46%	-8,03%	-27,17%
Индекс ММВБ Инновации	640,68	2,19%	-2,13%	-11,55%	-33,46%
Курс доллара (Ц/б РФ)					
USD / RUB	32,46	-0,51%	-0,22%	10,51%	16,68%

На прошедшей неделе Индекс ММВБ повысился на 1,07% до 1 421,28 (1 406,30 на 27 июля 2012г.).

Долларовый Индекс РТС вырос на 1,12% до 1 398,33 (1 382,82 на 27 июля 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю потерял в весе 0,51%.

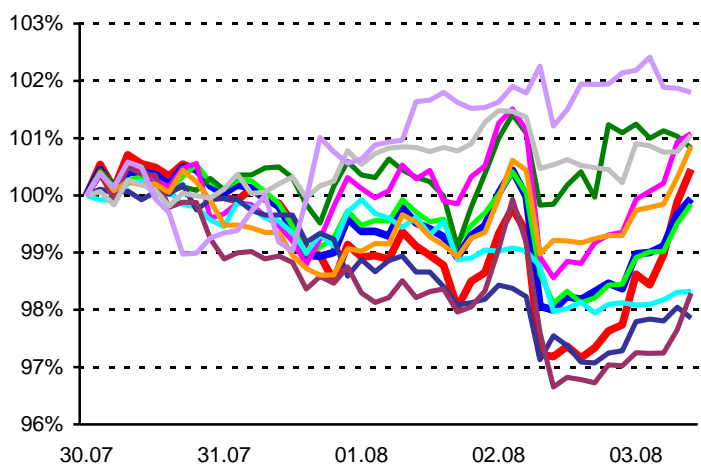
На фондовом рынке наблюдалось повышение волатильности: Российский индекс волатильности повысился на 0,39% до пункта (30,68 пункта на 27 июля 2012г.).

На прошедшей неделе большинство ключевых секторов экономики, представленных на российском фондовом рынке, показало положительную динамику. Лидером роста стала металлургия: повышение по отраслевому индексу составило 2,02%. Также существенное увеличение продемонстрировали потребительский и финансовый секторы – Индекс потребительского сектора вырос на 1,80%, а Индекс финансов прибавил в весе 1,69%. Наибольшее падение было отмечено в машиностроительном секторе – Индекс машиностроения понизился на 1,62%.

Индекс ММВБ Инновации вырос на 2,19%.

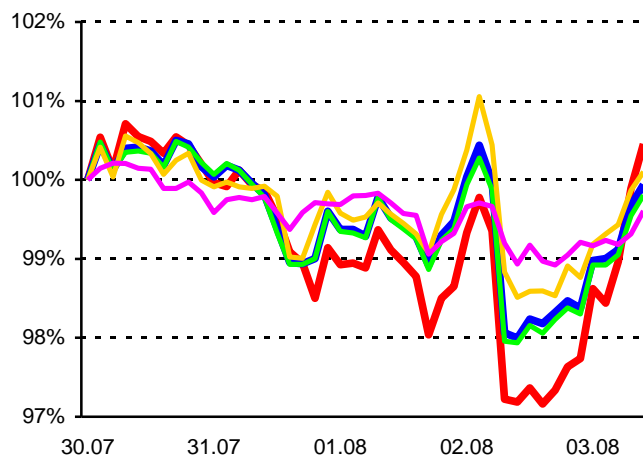
Наибольший рост продемонстрировали средние по капитализации компании – Индекс компаний стандартной капитализации прибавил в весе 1,09%, Индекс компаний высокой капитализации вырос на 0,96%, а Индекс компаний базовой капитализации - на 0,28% соответственно.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



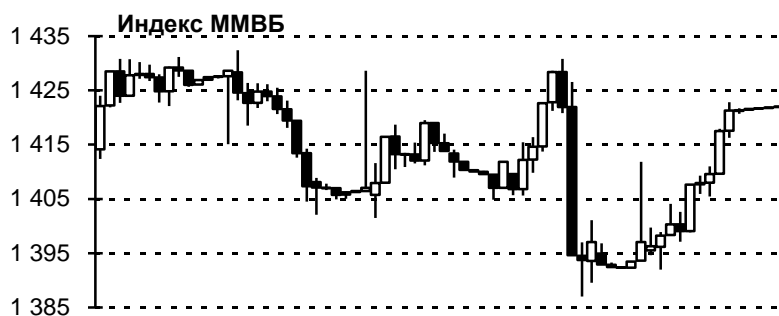
- Индекс РТС
- Нефть и газ
- Металлы и добыча
- Химия и нефтехимия
- Финансы
- Инновации
- Индекс ММВБ
- Потребительский сектор
- Машиностроение
- Электроэнергетика
- Телекоммуникации

КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ

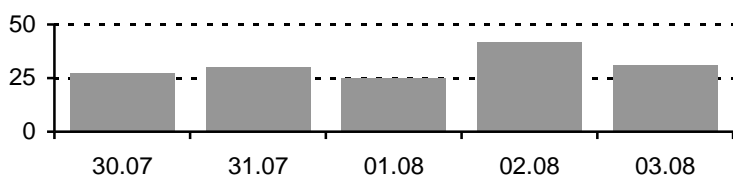


- Индекс РТС
- Высокая капит-я
- Базовая капит-я
- Индекс ММВБ
- Стандартная капит-я

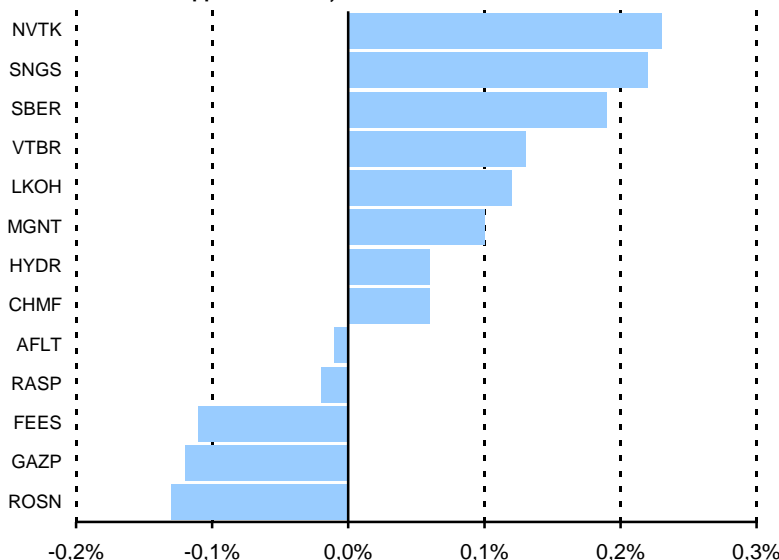
Индекс ММВБ



Объем торгов (осн.), млрд.руб.

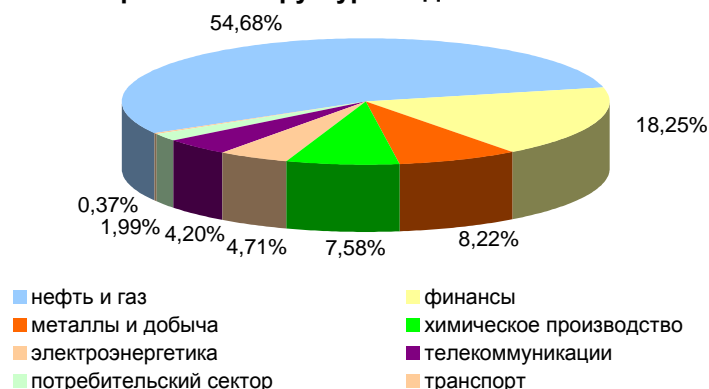


Влияние на Индекс ММВБ, %



Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	24	6	0	30
Влияние, %	+1,45%	-0,38%	0%	+1,07%

Отраслевая структура Индекса ММВБ



За неделю с 30 июля по 3 августа 2012г. российский рынок акций продемонстрировал положительную динамику. Индекс ММВБ вырос на 1,07% до 1 421,28 (1 406,30 на 27 июля 2012г.).

По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 1,12% ниже своего закрытия месяц назад (1 437,45 на 3 июля 2012г.) и находился на 14,14% ниже аналогичного показателя год назад (1 655,36 на 3 августа 2011г.).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил 155,41 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец недели составила 18 762,29 млрд. руб.

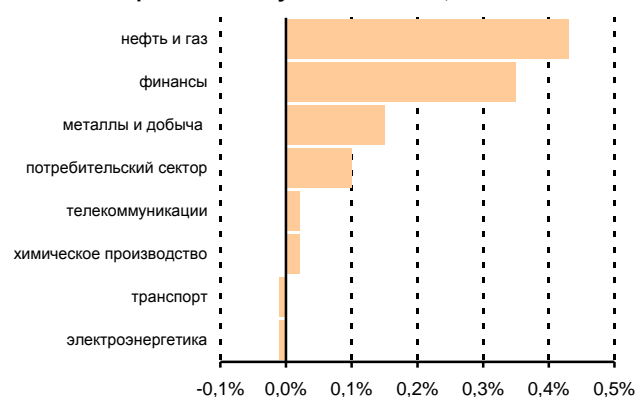
По итогам недели 24 акции, входящие в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику положительное воздействие (+1,45%), 6 ценных бумаг повлияли отрицательно (-0,38%).

Наибольший вклад в рост Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги нефти и газа (+0,43%) и финансов (+0,35%).

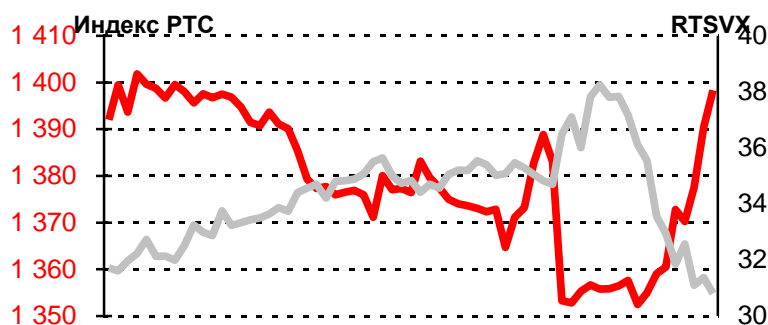
Наибольшее позитивное влияние на Индекс ММВБ оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО НОВАТЭК (+0,23%), ОАО Сургутнефтегаз (+0,22%) и ОАО Сбербанк России (+0,19 %).

На нефтегазовый сектор приходится 54,68% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 18,25%) и металлургия (8,22%).

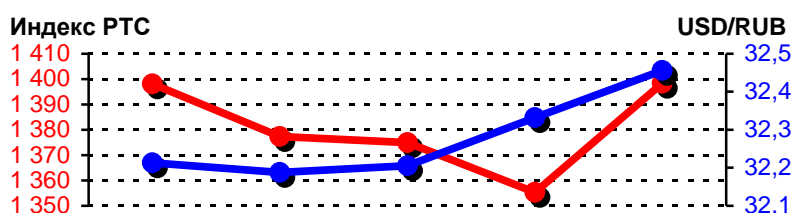
Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %



Индекс РТС



За неделю с 30 июля по 3 августа 2012г. Индекс РТС повысился на 1,12% до 1 398,33 (1 382,82 на 27 июля 2012г.). По состоянию на конец недели Индекс РТС был на 0,72% ниже своего закрытия месяц назад (1 408,43 на 3 июля 2012г.) и находился на 26,47% ниже аналогичного показателя год назад (1 901,73 на 3 августа 2011г.).



Повышение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось повышением волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX вырос на 0,39%.

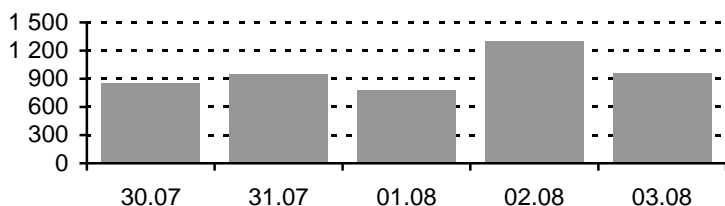
Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю понизился на 0,51%.

По итогам недели 34 из 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику положительное воздействие (+1,53%), 16 акций – отрицательное (-0,41%).

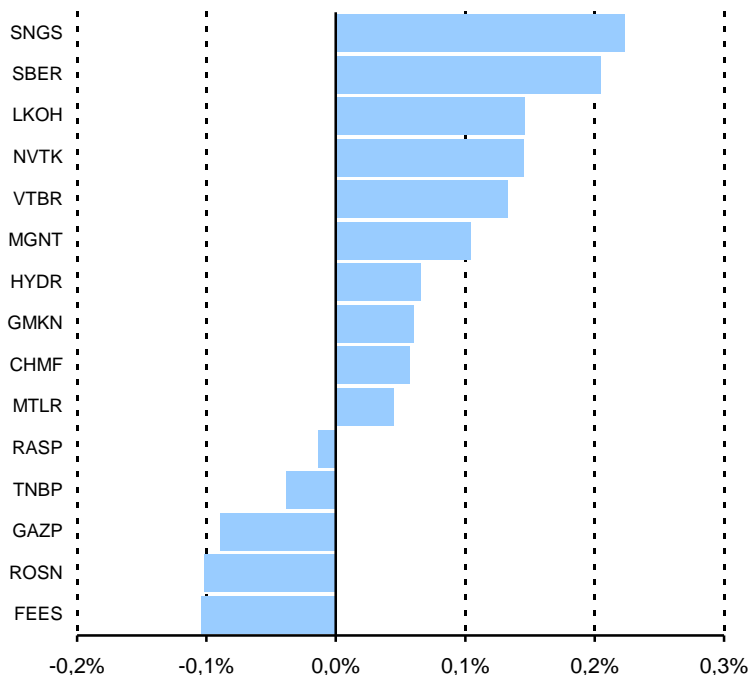
Наибольший вклад в рост Индекса РТС по итогам недели внесли ценные бумаги нефти и газа (+0,40%) и финансов (+0,38%).

Наибольшее позитивное влияние на Индекс РТС оказало повышение цен на обыкновенные акции ОАО Сургутнефтегаз (+0,22%), ОАО Сбербанк России (+0,20%) и ОАО ЛУКОЙЛ (+0,15%).

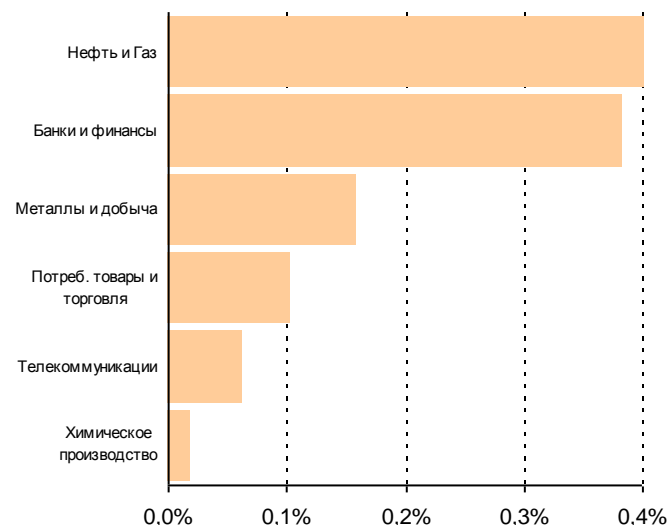
Объем торгов (осн.), млн.долл.



Влияние на Индекс РТС, %



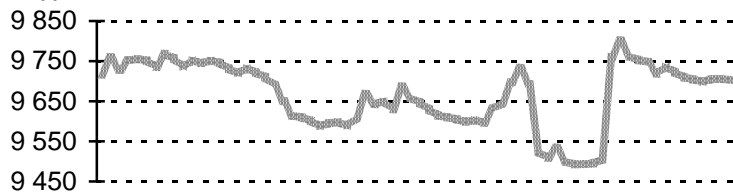
Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %



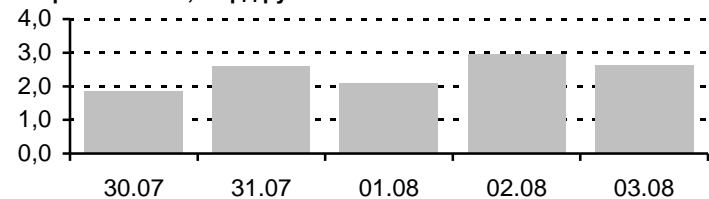
Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	34	16	0	50
Влияние, %	+1,53%	-0,41%	0%	+1,12%

Индекс RTS Standard

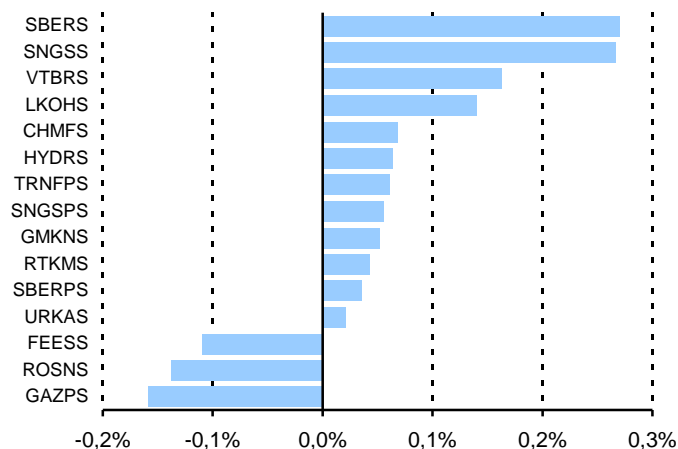
Индекс RTS Standard



Оборот Standard, млрд.руб.*



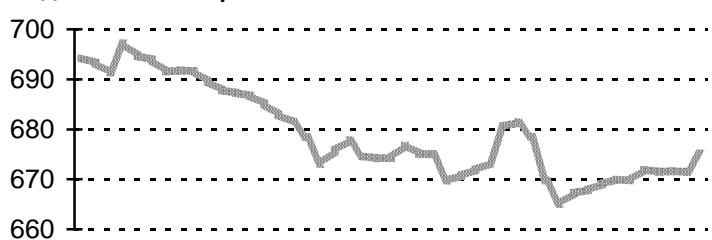
Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %



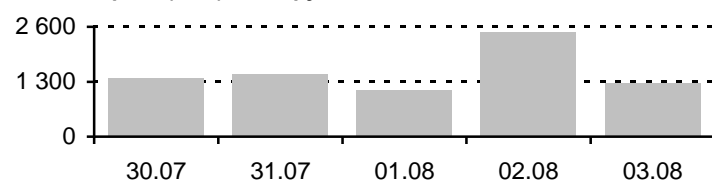
* по акциям из состава Индекса RTS Standard

Индекс РТС Сибирь

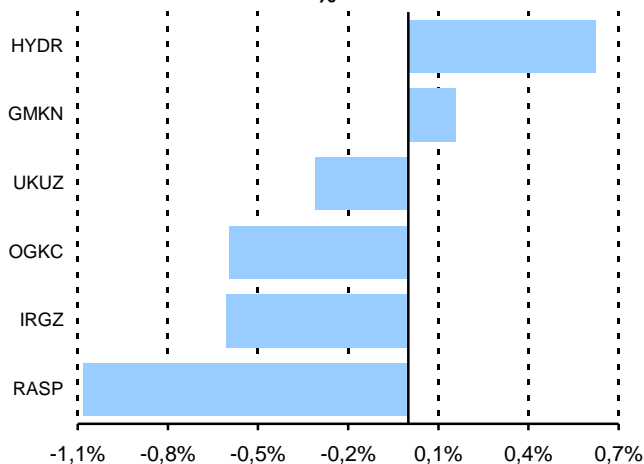
Индекс РТС Сибирь



Объем торгов (осн.)*, млн.руб.



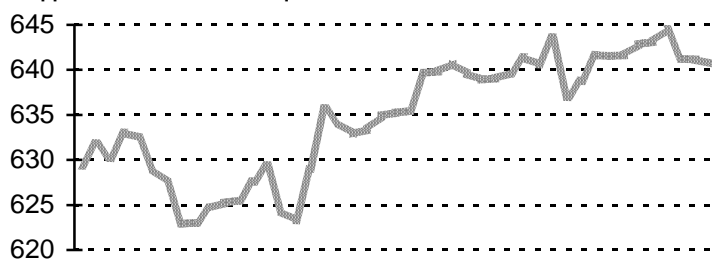
Лидеры влияния на Индекс РТС Сибирь, %



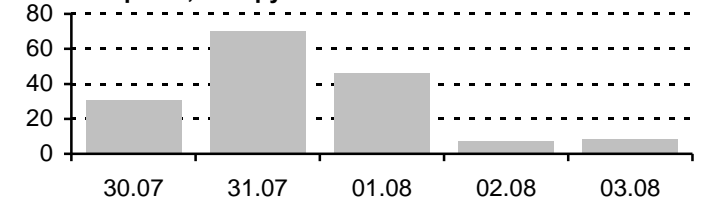
* по акциям из состава Индекса РТС Сибирь

Индекс ММВБ Инновации

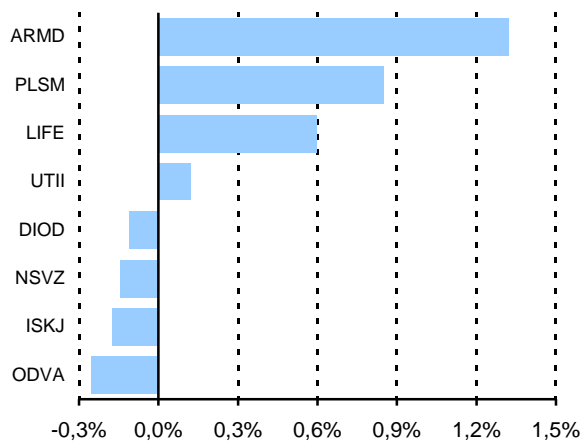
Индекс ММВБ Инновации



Объем торгов*, млн.руб.



Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



* по акциям из состава Индекса ММВБ инновации

Долговой рынок

Индекс	Значение 03.08.2012	Изменение за период			
		неделя	месяц	квартал	год
Индексы государственных облигаций					
RGBI	131,59	0,14%	1,22%	0,02%	-1,35%
RGBI-tr	289,88	0,21%	1,82%	1,82%	6,04%
Доходность (бп)	7,60	-9 б.п.	-26 б.п.	19 б.п.	52 б.п.
Индексы корпоративных облигаций					
MICEXCBI CP	92,12	0,17%	0,43%	-0,91%	-3,72%
MICEXCBI TR	215,34	0,26%	1,12%	0,99%	4,33%
Доходность (бп)	8,73	-20 б.п.	-32 б.п.	20 б.п.	182 б.п.
Индексы муниципальных облигаций					
MICEXMBI CP	96,12	-0,02%	0,20%	-0,73%	-3,28%
MICEXMBI TR	159,83	0,06%	0,92%	0,71%	3,58%
Доходность (бп)	8,35	12 б.п.	-6 б.п.	30 б.п.	152 б.п.
Индексы активов пенсионных накоплений					
Консервативный	1 458,52	0,12%	0,90%	1,55%	4,04%
Сбалансированный	1 306,84	0,42%	1,01%	0,40%	-1,18%
Агрессивный	1 154,55	0,79%	1,16%	-0,53%	-6,52%
Индикаторы ставок РЕПО по акциям					
Овернайт	5,64	-14 б.п.	-21 б.п.	-57 б.п.	188 б.п.
1 неделя	5,34	-73 б.п.	13 б.п.	-115 б.п.	204 б.п.
2 недели	7,14	0	-61 б.п.	136 б.п.	214 б.п.
Индикаторы ставок РЕПО по облигациям					
Овернайт	5,83	-21 б.п.	-25 б.п.	-54 б.п.	146 б.п.
1 неделя	6,07	-7 б.п.	-23 б.п.	-29 б.п.	145 б.п.
2 недели	5,41	-31 б.п.	-166 б.п.	-127 б.п.	75 б.п.

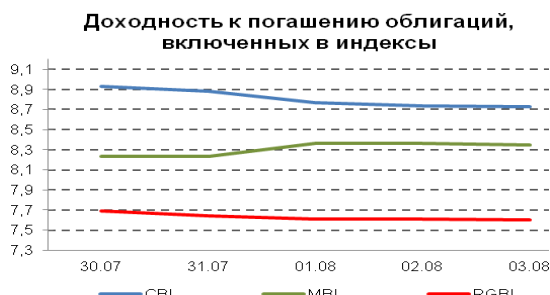
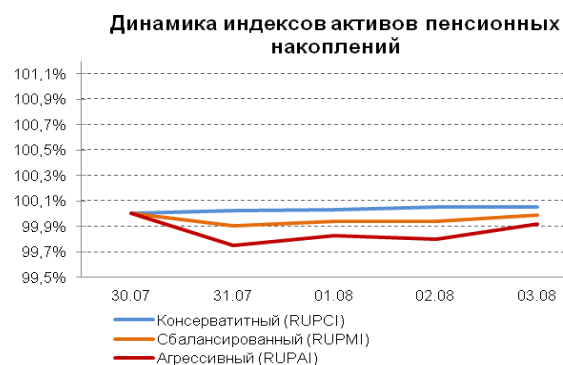
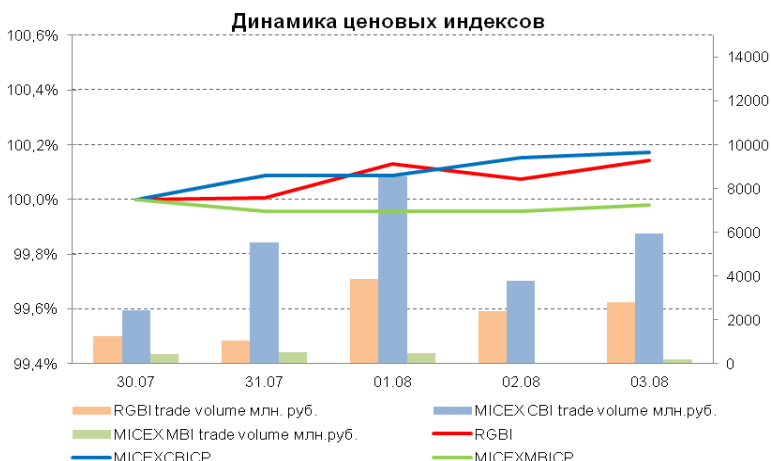
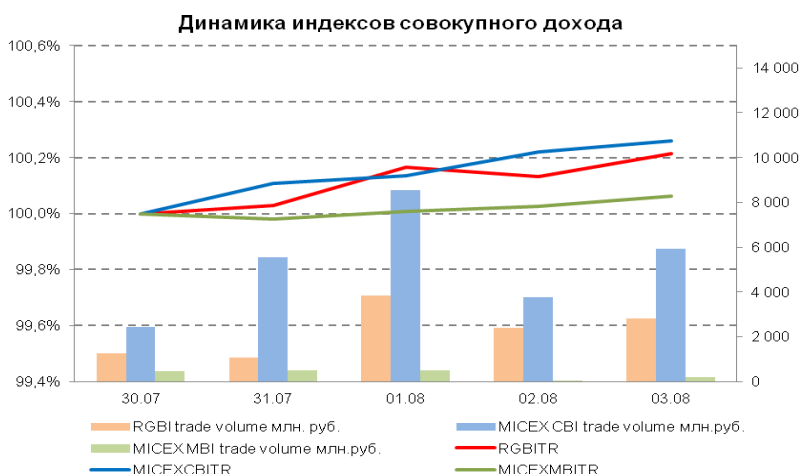
На прошедшей неделе ценовой Индекс государственных облигаций России (RGBI) вырос на 0,14% до 131,59 пунктов (131,24 на 27 июля 2012г.). Индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, вырос на 0,21% и составил 289,88 пункта. Объем торгов по облигациям, включенным в базу расчета RGBI, за прошедшую неделю составил 11,32 млрд. руб.

В секторе корпоративных облигаций индекс, рассчитанный по методике совокупного дохода, MICEX CBI TR вырос на 0,26% и составил 215,34 пункта; ценовой индекс - 92,12 пункта, рост на 0,17%.

Индекс муниципальных облигаций MICEX MBI TR (совокупный доход) вырос на 0,06% и составил 159,83 пункта, ценовой индекс муниципальных облигаций MICEX MBI CP снизился на 0,02% и составил 96,12.

Консервативная стратегия вложения средств по индексу пенсионных накоплений обеспечила бы рост на уровне 0,12% за неделю, агрессивная стратегия - рост на 0,79% за неделю.

Ставка РЕПО овернайт по облигациям за прошедшую неделю изменилась с 6,04% до 5,83% (снижение на 21 базисный пункт). Ставка РЕПО овернайт по акциям снизилась на 14 базисных пунктов и составила 5,64%.



Производные на индексы



За неделю с 30 июля по 3 августа объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 640,54 млрд. рублей или 7,24 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 577,40 млрд. рублей или 6,51 млн. контрактов.

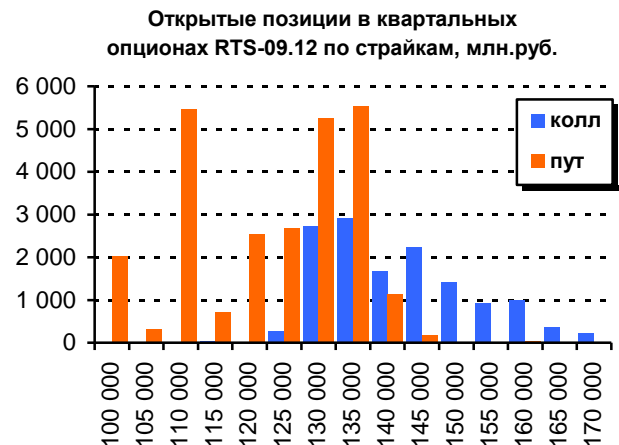
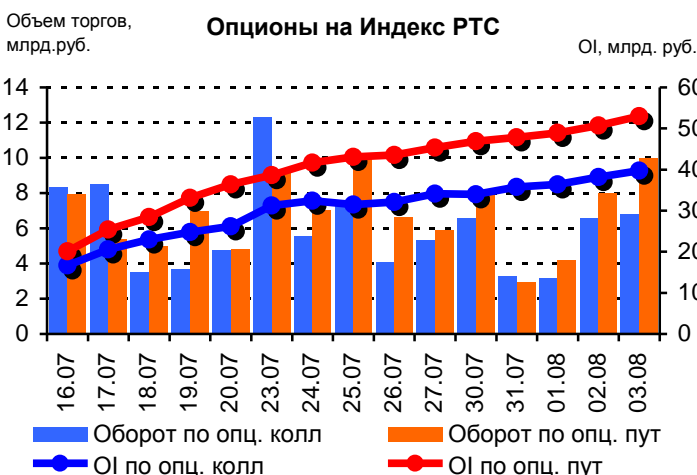
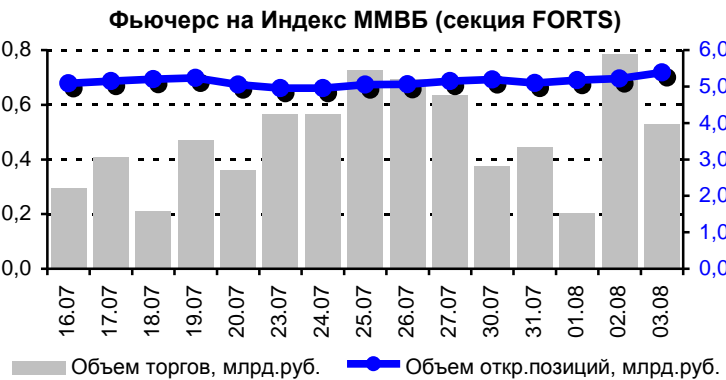
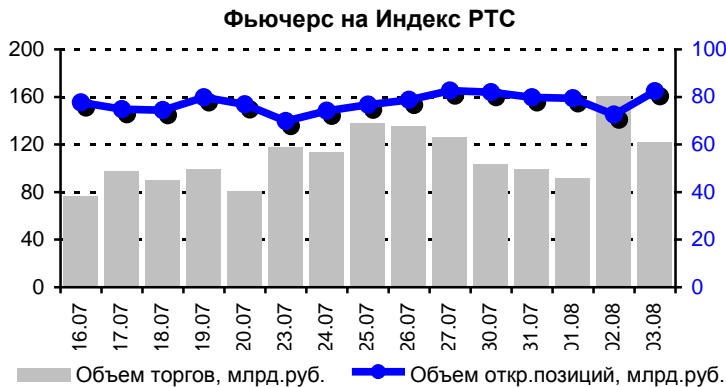
Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе преимущественно торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю прибавил в весе 1,12%, при этом сентябрьские и декабрьские фьючерсы подорожали на 1,20% и 1,53% соответственно.

Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю упал на 1,95%

Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММВБ, обращающимся в секции FORTS составил на прошедшей неделе 2,34 млрд. рублей или 16,49 тыс. контрактов. За неделю было отмечено увеличение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММВБ – на 3,48%

Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 59,24 млрд. рублей или 690,11 тыс. контрактов. Объем открытых позиций составил 92,69 млрд. рублей или 1,10 млн. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 57,14% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 135 000, максимум по опционам пут был также отмечен на страйке 135 000.

За прошедшую неделю повышение объема открытых позиций по опционам на Индекс РТС составило 16,27%.



Индексы Московской Биржи – 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 ММВБ 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 RTS – 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 ММВБ, а «валютной истории» – «история» отраслевых индексов RTS.

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 RTS 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 ММВБ – 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 RTS. 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-RTS

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