

Индекс	Значение 05.05.12	Изменение за период, %			
		неделя	месяц	квартал	год
Композитные индексы					
Индекс ММВБ	1 386,41	-5,91%	-9,09%	-11,40%	-15,72%
Индекс РТС	1 489,55	-6,55%	-9,32%	-8,37%	-22,27%
Индекс RTS Standard	9 584,00	-4,98%	-8,09%	-10,52%	-14,44%
Отраслевые индексы (руб. значения)					
Нефть и газ	2 915,49	-6,82%	-9,75%	-10,58%	-4,93%
Электроэнергетика	1 901,63	-7,99%	-15,98%	-20,33%	-31,89%
Потребительский сектор	4 615,90	-6,34%	-5,74%	2,70%	-12,15%
Телекоммуникации	2 096,07	-3,57%	-6,60%	-6,06%	-13,07%
Машиностроение	1 946,99	-9,71%	-10,02%	2,06%	-18,81%
Финансы	4 929,35	-3,50%	-7,76%	-11,21%	-19,28%
Химия и нефтехимия	7 043,70	-6,47%	-3,23%	-4,93%	11,22%
Металлы и добыча	2 920,97	-6,97%	-10,16%	-20,21%	-42,42%
Капитализационные индексы					
Высокая кап-я	2 213,05	-6,03%	-9,07%	-12,07%	-16,44%
Стандартная кап-я	2 342,49	-6,40%	-10,03%	-9,80%	-20,00%
Базовая кап-я	3 483,58	-6,21%	-9,49%	-9,92%	-28,75%
Тематические индексы					
Индекс волатильности	30,84	6,09%	3,91%	6,82%	11,77%
Индекс РТС Сибирь	717,05	-3,41%	-4,31%	-3,50%	-23,79%
Индекс ММВБ Инновации	716,26	-3,85%	-2,77%	-7,52%	-29,50%
Курс доллара (Ц/б РФ)					
USD / RUB	29,59	0,58%	0,56%	-1,96%	8,13%

На прошедшей неделе Индекс ММВБ снизился на 5,91% до 1 386,41 (1 473,50 на 28 апреля 2012г).

Долларовый Индекс РТС понизился на 6,55% до 1 489,55 (1 593,97 на 28 апреля 2012г.). Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 0,58%.

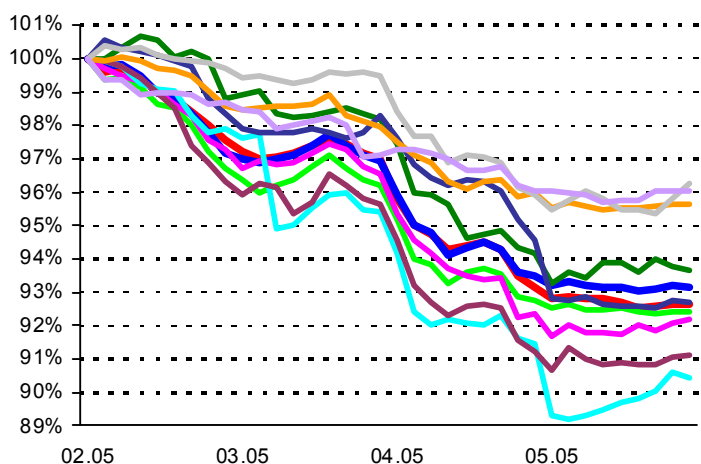
На фондовом рынке наблюдалось повышение волатильности: Российский индекс волатильности вырос на 6,09% до 30,84 пункта (29,07 пункта на 28 апреля 2012г).

На прошедшей неделе ключевые секторы экономики, представленные на российском фондовом рынке, показали отрицательную динамику. Лидером падения стало машиностроение: снижение по отраслевому индексу составило 9,71%. Также существенное падение продемонстрировали электроэнергетика и металлургия - Индекс электроэнергетики упал на 7,99%, а Индекс металлов и добычи потерял в весе 6,97%. Наименьшее снижение было отмечено в телекоммуникациях – Индекс телекоммуникаций снизился на 3,57%.

Индекс ММВБ Инновации упал на 3,85%.

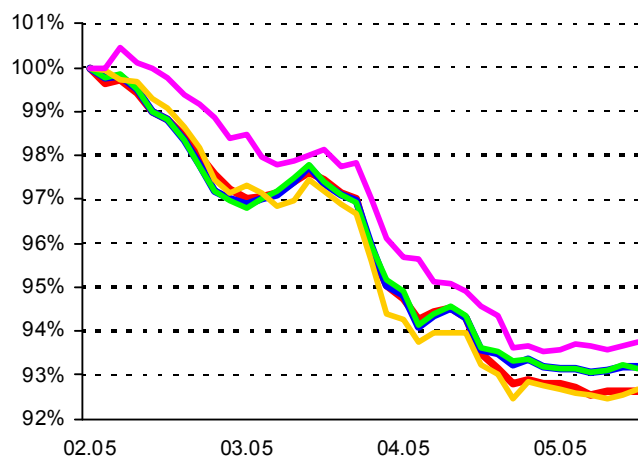
В наибольшей степени падение рынка акций затронуло средние по капитализации компании – Индекс компаний стандартной капитализации потерял в весе 6,40%, тогда как Индекс компаний базовой упал на 6,61%, а Индекс высокой капитализации снизился на 6,03%.

КЛЮЧЕВЫЕ СЕКТОРЫ



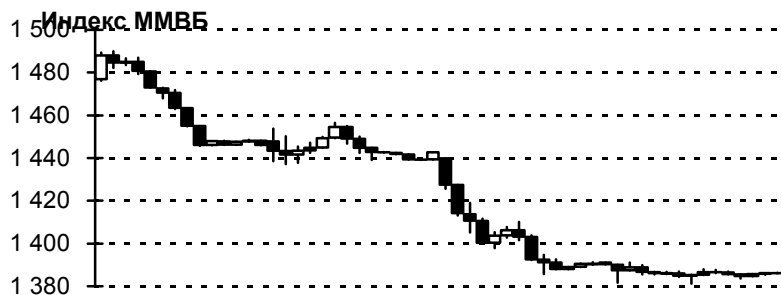
- Индекс РТС
- Нефть и газ
- Металлы и добыча
- Химия и нефтехимия
- Финансы
- Инновации
- Индекс ММВБ
- Потребительский сектор
- Машиностроение
- Электроэнергетика
- Телекоммуникации

КАПИТАЛИЗАЦИОННЫЕ ИНДЕКСЫ

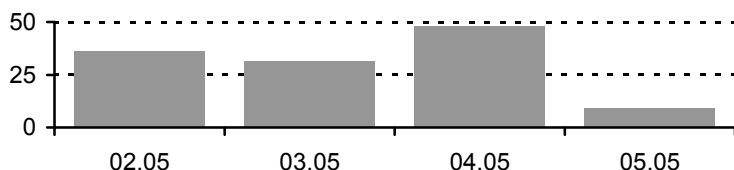


- Индекс РТС
- Высокая капит-я
- Базовая капит-я
- Индекс ММВБ
- Стандартная капит-я

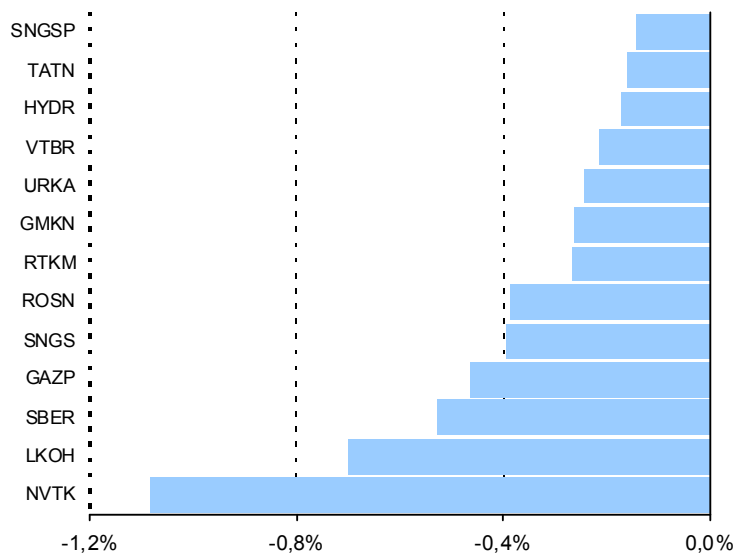
Индекс ММВБ



Объем торгов (осн.), млрд.руб.



Влияние на Индекс ММВБ, %



За неделю с 2 по 5 мая 2012г. российский рынок акций продемонстрировал отрицательную динамику. Индекс ММВБ упал на 5,91% до 1 386,41 (1 473,50 на 28 апреля 2012г.). По состоянию на конец недели Индекс ММВБ был на 9,09% ниже своего закрытия месяц назад (1 525,11 на 5 апреля 2012г) и находился на 5,72% ниже аналогичного показателя год назад (1 644,92 на 5 мая 2011г).

Объем торгов в основном режиме ценными бумагами, включенными в базу расчета индекса, составил 125,21 млрд. руб., а капитализация акций, входящих в индекс, на конец недели составила 18 572,96 млрд. руб.

По итогам недели 30 акций, входящих в список Индекса ММВБ, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-5,91%).

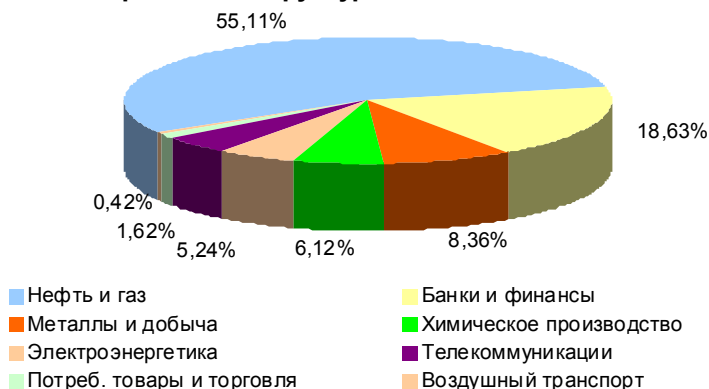
Наибольший вклад в падение Индекса ММВБ по итогам недели внесли ценные бумаги нефти и газа (-3,44%) и финансового сектора (-0,76%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс ММВБ оказало падение цен на обыкновенные акции ОАО НОВАТЭК (-1,08%), ОАО ЛУКОЙЛ (-0,70%) и ОАО Сбербанк (-0,53%).

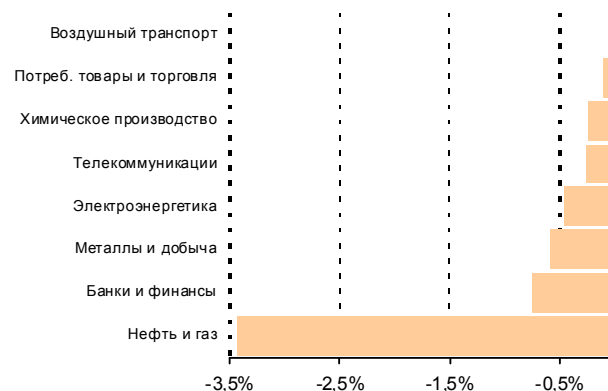
На нефтегазовый сектор приходится 55,1% суммарной капитализации Индекса ММВБ. Среди остальных отраслей выделяются финансы (вес в индексе 18,6%) и металлургия (8,4%).

Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	0	30	0	31
Влияние, %	+0%	-5,91%	0%	-5,91%

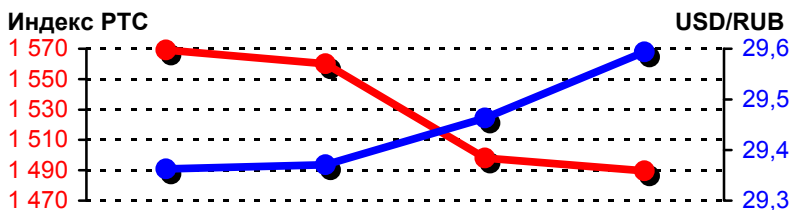
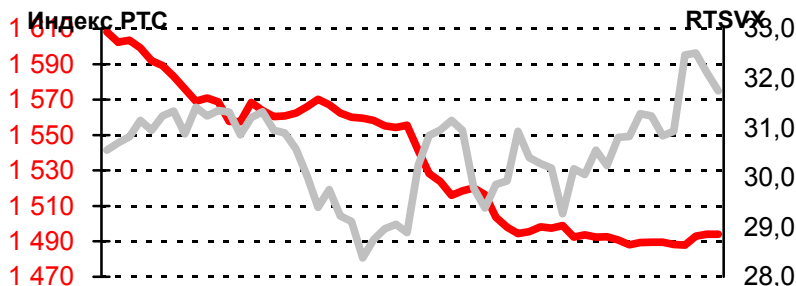
Отраслевая структура Индекса ММВБ



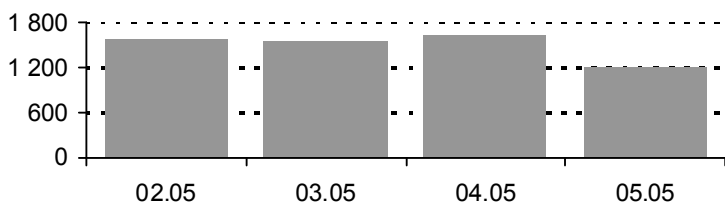
Вклад сектора в динамику Индекс ММВБ, %



Индекс РТС

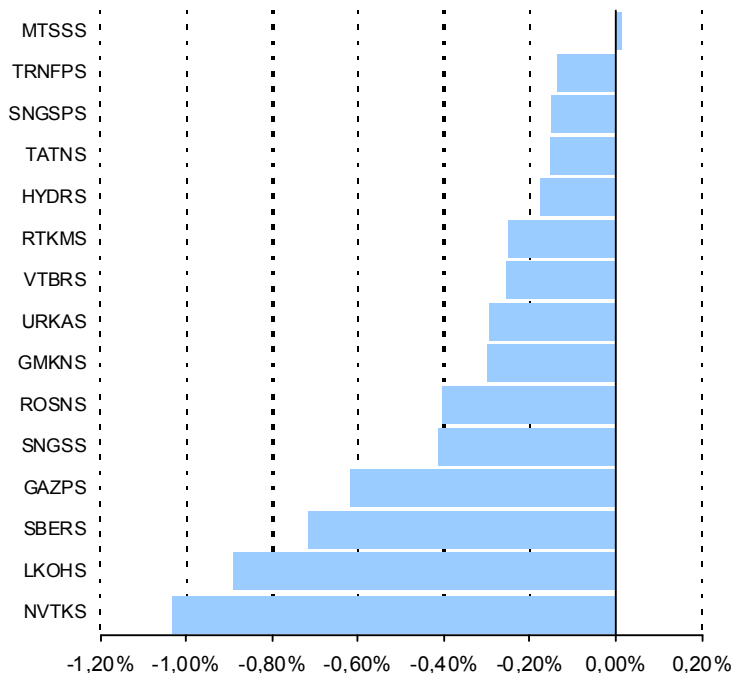


Объем торгов Standard&Classica, млн.долл.



* с учетом внебиржевых сделок

Влияние на Индекс РТС, %



За неделю с 2 по 5 мая 2012г. Индекс РТС снизился на 6,55% до 1 489,55 (1 593,97 на 28 апреля 2012г.) По состоянию на конец недели Индекс РТС был на 9,32% ниже своего закрытия месяц назад (1 642,62 на 5 апреля 2012г.) и находился на 22,27% ниже аналогичного показателя год назад (1 916,33 на 5 мая 2011г.).

Понижение Индекса РТС на прошедшей неделе сопровождалось ростом волатильности: Российский индекс волатильности RTSVX повысился на 6,09%.

Курс доллара США по отношению к рублю за прошедшую неделю вырос на 0,58%.

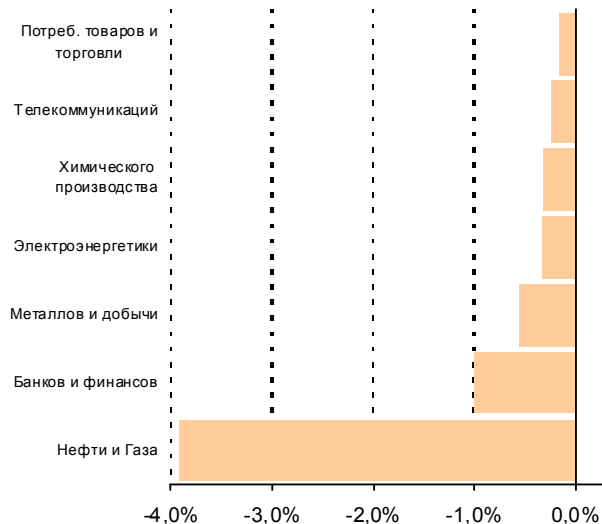
По итогам недели 29 из 50 акций, входящих в список Индекса РТС, оказали на его динамику отрицательное воздействие (-6,56%), 1 ценная бумага повлияла положительно (+0,01%), цена 20 ценных бумаг не изменилась.

Наибольший вклад в снижение Индекса РТС по итогам недели внесли ценные бумаги нефтегазового сектора (-3,91%) и финансов (-1,00%).

Наибольшее негативное влияние на Индекс РТС оказало понижение цен на обыкновенные акции ОАО Новатэк (-1,03%), ОАО ЛУКОЙЛ (-0,89%) и ОАО Сбербанк (-0,71%).

Наиболее позитивно на динамике Индекса РТС отразилось повышение цен на обыкновенные акции ОАО МТС (+0,01%).

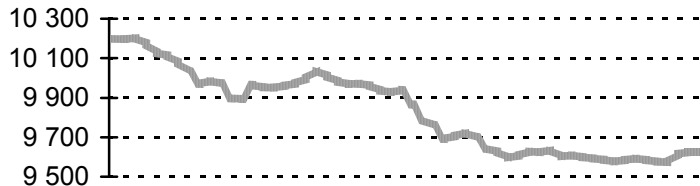
Вклад сектора в динамику Индекс РТС, %



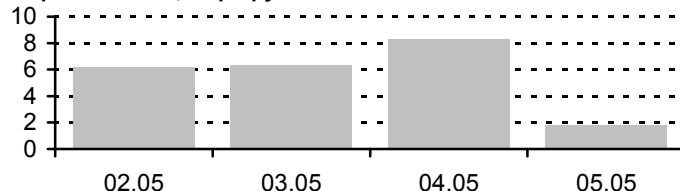
Изменение цены неделю	Рост	Снижение	Без изменений	Итоговое влияние, %
Число бумаг	1	29	20	50
Влияние, %	+0,01%	-6,56%	0%	-6,55%

Индекс RTS Standard

Индекс RTS Standard

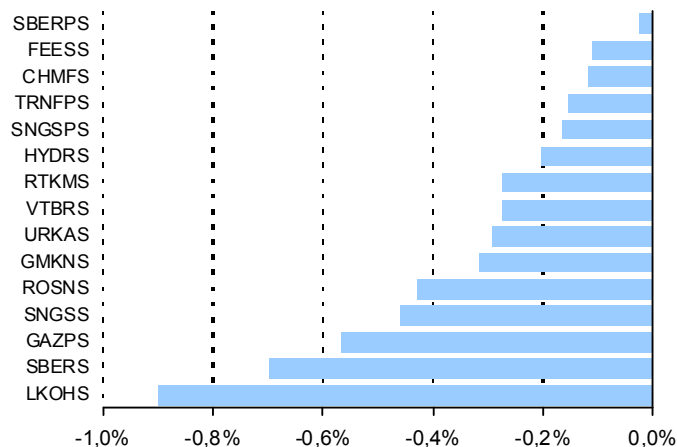


Оборот Standard, млрд.руб.*



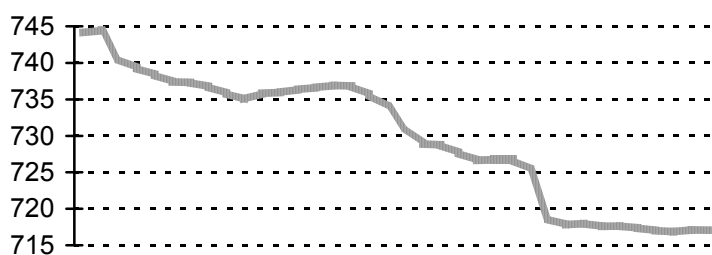
* по акциям из состава Индекса RTS Standard

Лидеры влияния на Индекс RTS Standard, %

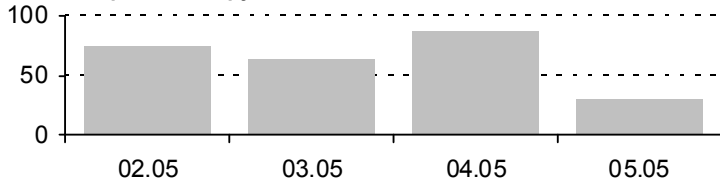


Индекс РТС Сибирь

Индекс РТС Сибирь

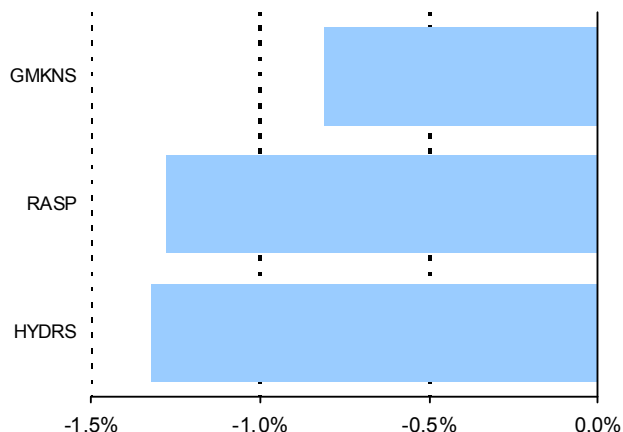


Объем торгов*, млн.руб.



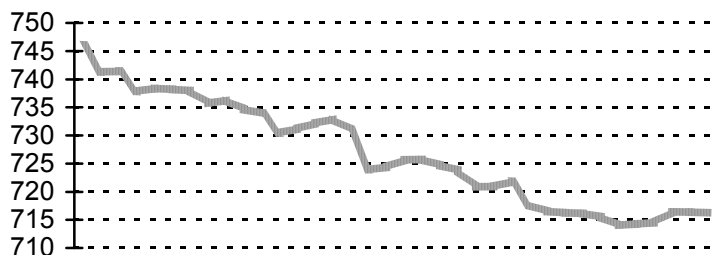
* по акциям из состава Индекса РТС Сибирь

Лидеры влияния на Индекс РТС Сибирь, %

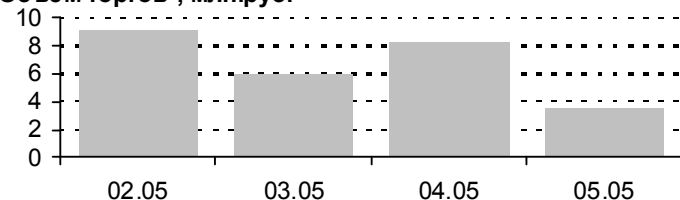


Индекс ММВБ Инновации

Индекс ММВБ Инновации

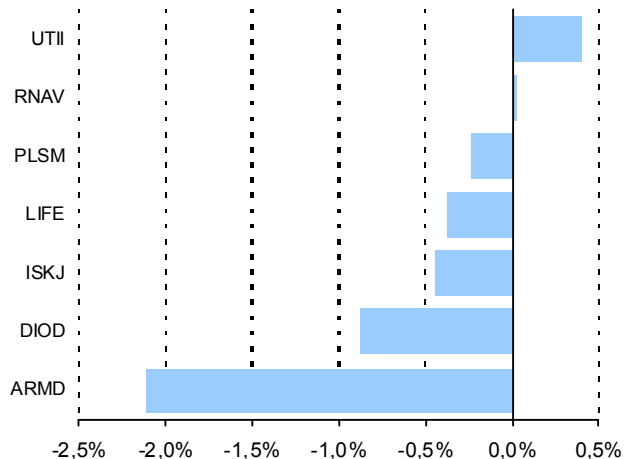


Объем торгов*, млн.руб.



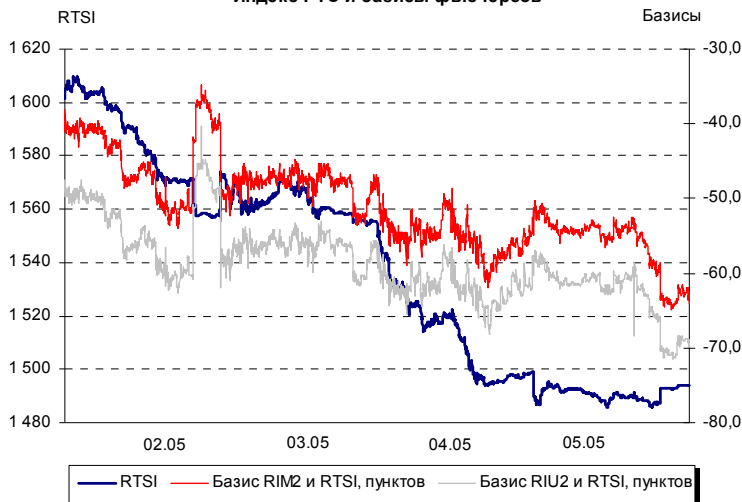
* по акциям из состава Индекса ММВБ инновации

Лидеры влияния на Индекс ММВБ Инновации, %



Производные на индексы

Индекс РТС и базисы фьючерсов



За неделю с 2 по 5 мая 2012г. объем торгов производными инструментами на индексы на срочной секции FORTS составил 427,27 млрд. рублей или 4,81 млн. контрактов.

Наиболее ликвидным срочным контрактом на рынке FORTS является фьючерс на Индекс РТС, объем торгов по этому контракту на прошлой неделе составил 378,80 млрд. рублей или 4,28 млн. контрактов.

Фьючерсы на Индекс РТС на прошлой неделе торговались в бэквордации. Индекс РТС за неделю потерял в весе 6,55%, при этом июньские фьючерсы подешевели на 7,23%, а сентябрьские – на 7,17%.

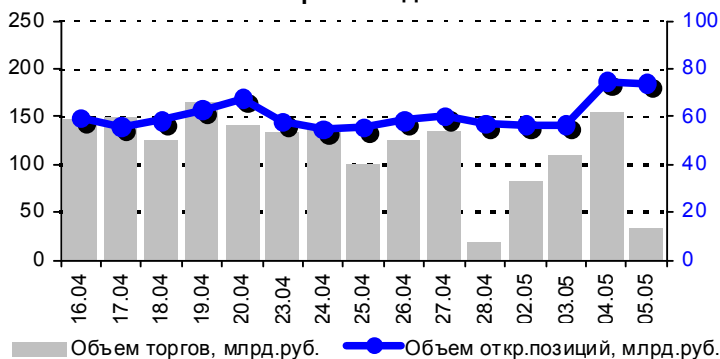
Суммарный объем открытых позиций в контрактах по фьючерсам на Индекс РТС за неделю вырос на 37,64%.

Объем торгов фьючерсным контрактом на Индекс ММББ, обращающимся в секции FORTS составил на прошедшей неделе 1,49 млрд. рублей или 10,57 тыс. контрактов. За прошедшую неделю было отмечено уменьшение объема открытых позиций в контрактах по фьючерсу на Индекс ММББ – на -4,79%.

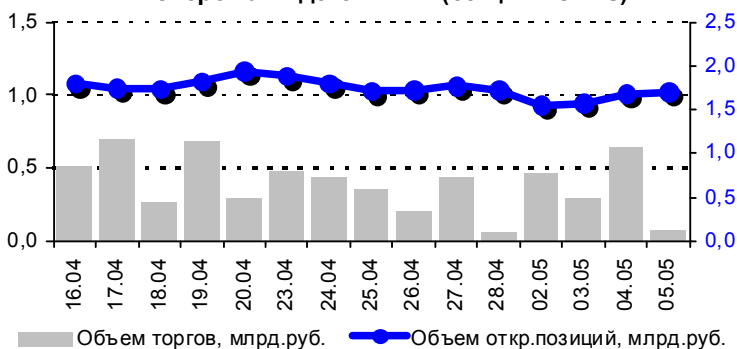
Объем торгов опционами на Индекс РТС составил на прошлой неделе 44,13 млрд. рублей или 491,06 тыс. контрактов. Объем открытых позиций по состоянию на конец недели составил 83,08 млрд. рублей или 887,58 тыс. контрактов. При этом на долю опционов колл приходилось 61,75% открытого интереса по опционам. Наибольший открытый интерес по опционам колл был сосредоточен на страйке 170 000, максимум по опционам пут был отмечен на страйке 135 000.

За прошедшую неделю увеличение объема открытых позиций по опционам составило 10,21%.

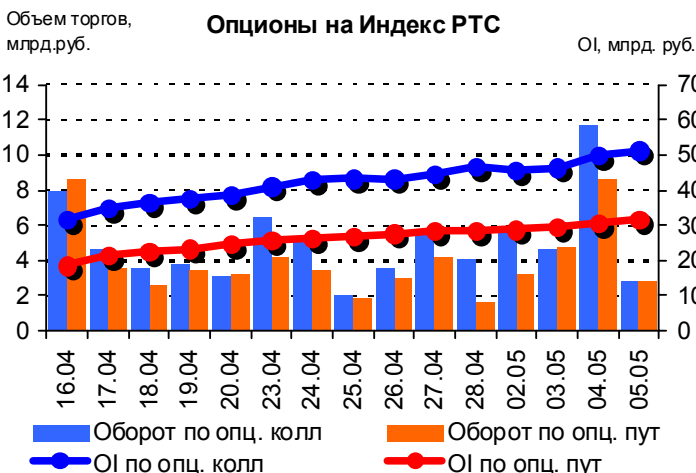
Фьючерс на Индекс РТС



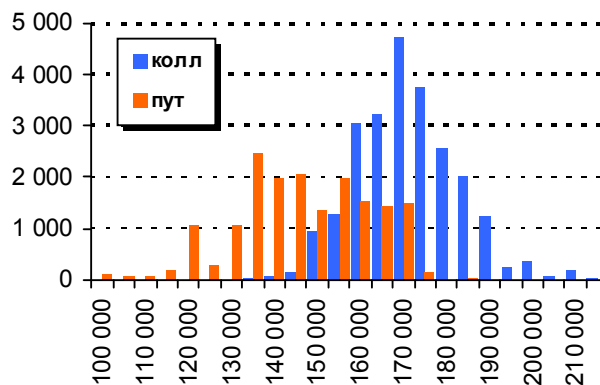
Фьючерс на Индекс ММББ (секция FORTS)



Опционы на Индекс РТС



Открытые позиции в квартальных опционах RTS-06.12 по страйкам, млн.руб.



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

Региональные индексы – индексы акций, корзины которых включают ценные бумаги, допущенные к торгам в ММВБ-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 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 РТС. При расчете стоимости применяется формула Блэка-Шоулза.

ОАО ММВБ-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