

# Индекс ММВБ

## ■ Основной индикатор российского фондового рынка

### Общая информация

Индекс ММВБ – ценовой, взвешенный по рыночной капитализации (free-float) 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, представленных на Фондовой бирже ММВБ (ФБ ММВБ).

Расчет индекса производится в режиме реального времени в рублях, что делает его инвариантным по отношению к изменению курсов валют и позволяет отражать реальное состояние российского рынка.

В базу расчета Индекса ММВБ включены акции эмитентов, суммарная капитализация которых составляет более 80% от совокупной капитализации эмитентов, акции которых торгуются на бирже.

Правила расчета Индекса ММВБ в полной мере отвечают международным стандартам построения фондовых индексов в части сбалансированности индекса, а также требованиям, предъявляемым к индексам, на основе которых могут быть созданы российские индексные ПИФы.

**Количество акций в базе расчета** 30

**Дата начала расчета** 22 сентября 1997 года

**Начальное значение** 100

**Периодичность внесения изменений в базу расчета** 2 раза в год, 25 апреля и 25 октября

### Расчет значений

Значение пересчитывается при совершении каждой сделки с акциями, включенными в базу расчета индекса, на ФБ ММВБ в режиме основных торгов в период с 10:30 до 18:45 по московскому времени.

**Периодичность публикации значений** 1 раз в секунду

### Изменение за год

2006	67,50%
2007	11,54%
2008	-67,20%

### Объем торгов

Среднемесячный объем торгов акциями, включенными в базу расчета Индекса ММВБ, составляет более 1,5 трлн. руб. (50 млрд. долл. США).

### Максимальное значение

1970,46 (12 декабря 2007 года)

### Основные принципы расчета

Методика расчета Индекса ММВБ, а также порядок отбора акций, сделки с которыми учитываются при расчете индекса, определены в Правилах расчета Индекса ММВБ, которые разрабатываются при участии Индексного комитета при ФБ ММВБ.

Индекс ММВБ рассчитывается как отношение суммарной рыночной капитализации акций, включенных в базу расчета индекса, к суммарной рыночной капитализации этих акций на начальную дату, умноженное на значение индекса на начальную дату.

Правилами расчета Индекса ММВБ предусмотрен четкий и прозрачный механизм формирования базы расчета индекса. Основными характеристиками сбалансированности и репрезентативности Индекса ММВБ являются:

- Вес акций отдельного эмитента в базе расчета индекса ограничен величиной 15% (на дату ежеквартального ребалансинга).
- Суммарный вес любых 5 акций в индексе не превышает 60%.
- Минимально допустимое значение коэффициента free-float каждой акции составляет 5%.
- Суммарный среднесуточный объем торгов акциями с наименьшим весом в индексе, суммарный вес которых в индексе составляет 25%, составляет 11 млрд. руб. (382 млн. долл. США)..

### Финансовые продукты

Индекс ММВБ является базовым активом расчетного фьючерса, торги которым проводятся на ФБ ММВБ.

Индекс ММВБ используется в качестве бэнчмарка для построения абсолютного большинства российских индексных ПИФов — из 44 зарегистрированных индексных ПИФов на индексы акций 36 индексных ПИФов созданы на базе Индекса ММВБ.

### Отраслевой состав базы расчета

по состоянию на 26 октября 2009 года

Отрасль	Кол-во акций	Вес в индексе
Нефть и газ	9	52,0%
Металлургия и горнодобыча	7	16,9%
Банки	3	16,3%
Телекоммуникации	4	7,0%
Электроэнергетика	5	5,3%
Химическая промышленность	1	2,2%
Транспорт	1	0,3%
	<b>30</b>	<b>100%</b>

## Состав базы расчета

В период с 26 октября 2009 года по 23 апреля 2010 года

Эмитент, категория акции	Отрасль	Вес в индексе*
ОАО "ЛУКОЙЛ", ао	Нефть и газ	15,00%
ОАО "Газпром", ао	Нефть и газ	15,00%
Сбербанк России (ОАО), ао	Банки	12,35%
Сбербанк России (ОАО), ап	Банки	0,81%
ОАО "НК "Роснефть", ао	Нефть и газ	8,23%
ОАО "ГМК "Норильский никель", ао	Металлургия и горнодобыча	7,96%
ОАО "Мобильные ТелеСистемы", ао	Телекоммуникации	5,43%
ОАО "Полюс Золото", ао	Металлургия и горнодобыча	4,53%
ОАО "Татнефть", ао	Нефть и газ	3,96%
ОАО "НОВАТЭК", ао	Нефть и газ	3,50%
ОАО "Сургутнефтегаз", ао	Нефть и газ	3,49%
ОАО "Сургутнефтегаз", ап	Нефть и газ	1,15%
ОАО Банк ВТБ, ао	Банки	3,09%
ОАО "РусГидро", ао	Электроэнергетика	2,42%
ОАО "Уралкалий", ао	Химическая промышленность	2,17%
ОАО "ФСК ЕЭС", ао	Электроэнергетика	1,80%
ОАО "Новолипецкий металлургический комбинат", ао	Металлургия и горнодобыча	1,60%
ОАО "Ростелеком", ао	Телекоммуникации	1,30%
ОАО "Северсталь", ао	Металлургия и горнодобыча	1,30%
ОАО "АК "Транснефть", ап	Нефть и газ	0,91%
ОАО "Газпром нефть", ао	Нефть и газ	0,81%
ОАО "ММК", ао	Металлургия и горнодобыча	0,65%
ОАО "Мосэнерго", ао	Электроэнергетика	0,46%
ОАО ОГК-3, ао	Электроэнергетика	0,42%
ОАО "Распадская", ао	Металлургия и горнодобыча	0,41%
ОАО "Полиметалл", ао	Металлургия и горнодобыча	0,41%

ОАО "АЭРОФЛОТ", ао	Транспорт	0,26%
ОАО ОГК-5, ао	Электроэнергетика	0,23%
ОАО "Уралсвязьинформ", ао	Телекоммуникации	0,21%
ОАО "ВолгаТелеком", ао	Телекоммуникации	0,15%

\* по состоянию на 26 октября 2009 года

### Лист ожидания

Пересмотр листа ожидания Индекса ММВБ предполагает ежеквартальный последовательный отбор акций из 100 акций с наибольшей капитализацией, затем из 60 наиболее ликвидных акций, значение коэффициента free-float которых составляет более 5%.

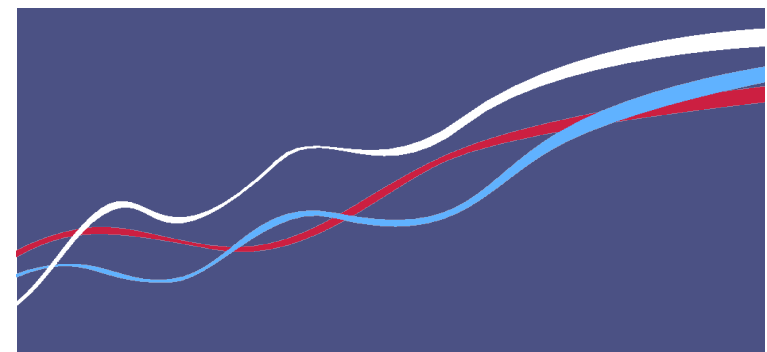
### Идентификаторы

MICEX – MICEXINDEXCF  
ISIN – RU000A0JP7K5  
Bloomberg – INDEXCF  
Reuters – .MCX

### Контакты

Более подробная информация об Индексе ММВБ и семействе индексов ММВБ размещена на Интернет-представительстве ММВБ [www.micex.ru/marketdata/indices/today](http://www.micex.ru/marketdata/indices/today)

# Индексы ММВБ



## Индекс ММВБ