

# ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

**RTS** БИРЖА



МОСКОВСКАЯ  
БИРЖА

# ФУНКЦИИ БИРЖЕВЫХ ИНДЕКСОВ

- **Диагностическая**

Способность системы индексов характеризовать состояние и динамику развития как национальной экономики, так и ее отдельных составляющих.

- **Индикативная**

Наличие объективной оценки ценовой ситуации на фондовом рынке дает точку отсчета для оценки поведения крупных инвестиционных фондов, отдельных инвесторов и портфельных менеджеров.

- **Спекулятивная функция**

Способность мгновенно реагировать на изменение широкого круга явлений экономического, политического и социального характера.

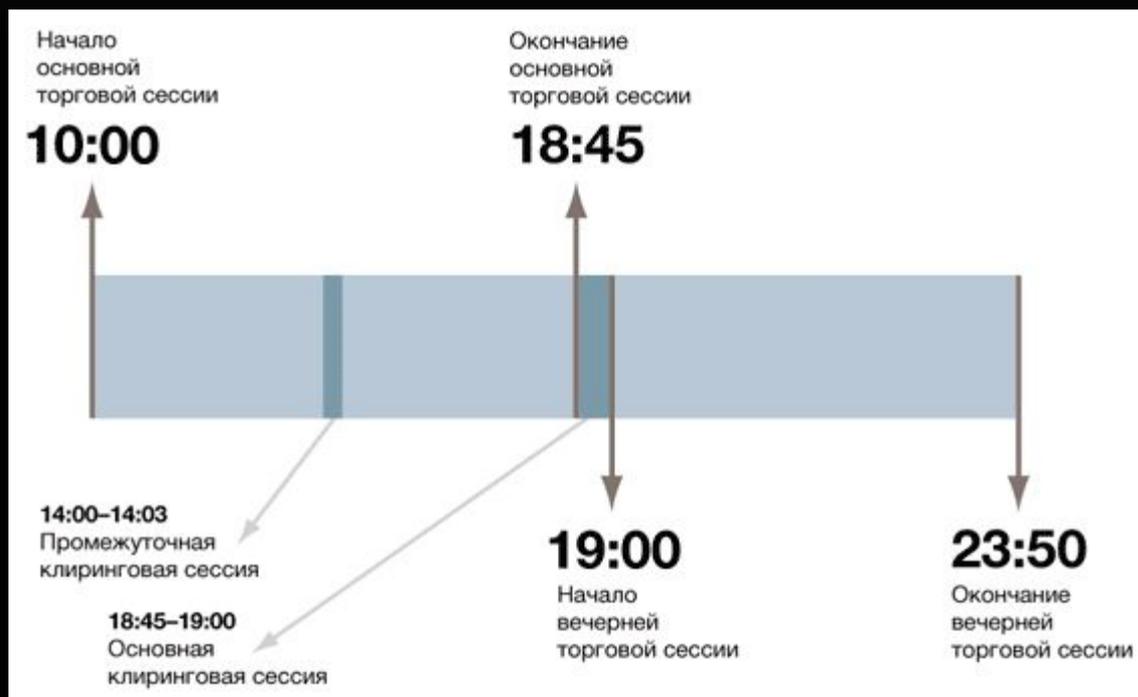
- **Ведущими считаются фондовые индексы РТС и ММВБ из-за наибольшего объема торгов на фондовых биржах РТС и ММВБ. Незначительные различия в динамике индексов определяется методом расчета индекса и совокупностью ценных бумаг, входящих в индекс.**

# ФОНДОВЫЙ ИНДЕКС РТС

- Индекс РТС (RTSI, RTS Index) — фондовый индекс, основной индикатор фондового рынка России, расчёт которого начался 1 сентября 1995 года со 100 пунктов. В настоящее время рассчитывается Московской Биржей.
- После объединения фондовых бирж РТС и ММВБ, индекс РТС стал одним из основных индексов Московской биржи наряду с индексом ММВБ. Рассчитываемый в долларах США индекс РТС имеет единую базу расчёта с рассчитываемым в рублях индексом ММВБ.

- В июле 1995 года открылись первые официальные торги в РТС ( RTS Russia ), 83 ценные бумаги были допущены к торгам. Объем торгов в первый день составил USD 576 тыс. Сейчас количество ценных бумаг около 500, а среднедневной объем торгов составляет более USD 4 млрд. По общему объему торгов акциями и облигациями РТС ( RTS Russia ) существенно проигрывает своему конкуренту ФБ ММВБ. Тем не менее, рассчитываемый биржей индекс РТС ( RTS Russia ) по традиции считается основным индикатором российского фондового рынка и ведет свою историю с 1995г.

# ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ НА РТС



# РАСЧЁТ ИНДЕКСА

$$I_n = I_1 * \frac{MC_n}{MC_1},$$

$MC_n$  - сумма рыночных капитализаций акций на текущее время:

$$MC_n = \sum_{i=1}^N (K_{ni} * AP_{ni})$$

, где

$K_{ni}$  - количество обыкновенных акций, выпущенных  $i$ -ым эмитентом на текущую дату;

$AP_{ni}$  - цена акции  $i$ -го эмитента на расчётное время,

$N$ - число акций в списке, по которому рассчитывается индекс.

# Динамика индекса РТС\*



\*Акции 50-ти эмитентов

Изменение, %

Период: с 14.09.2005 по 14.12.2015

Изменение, %



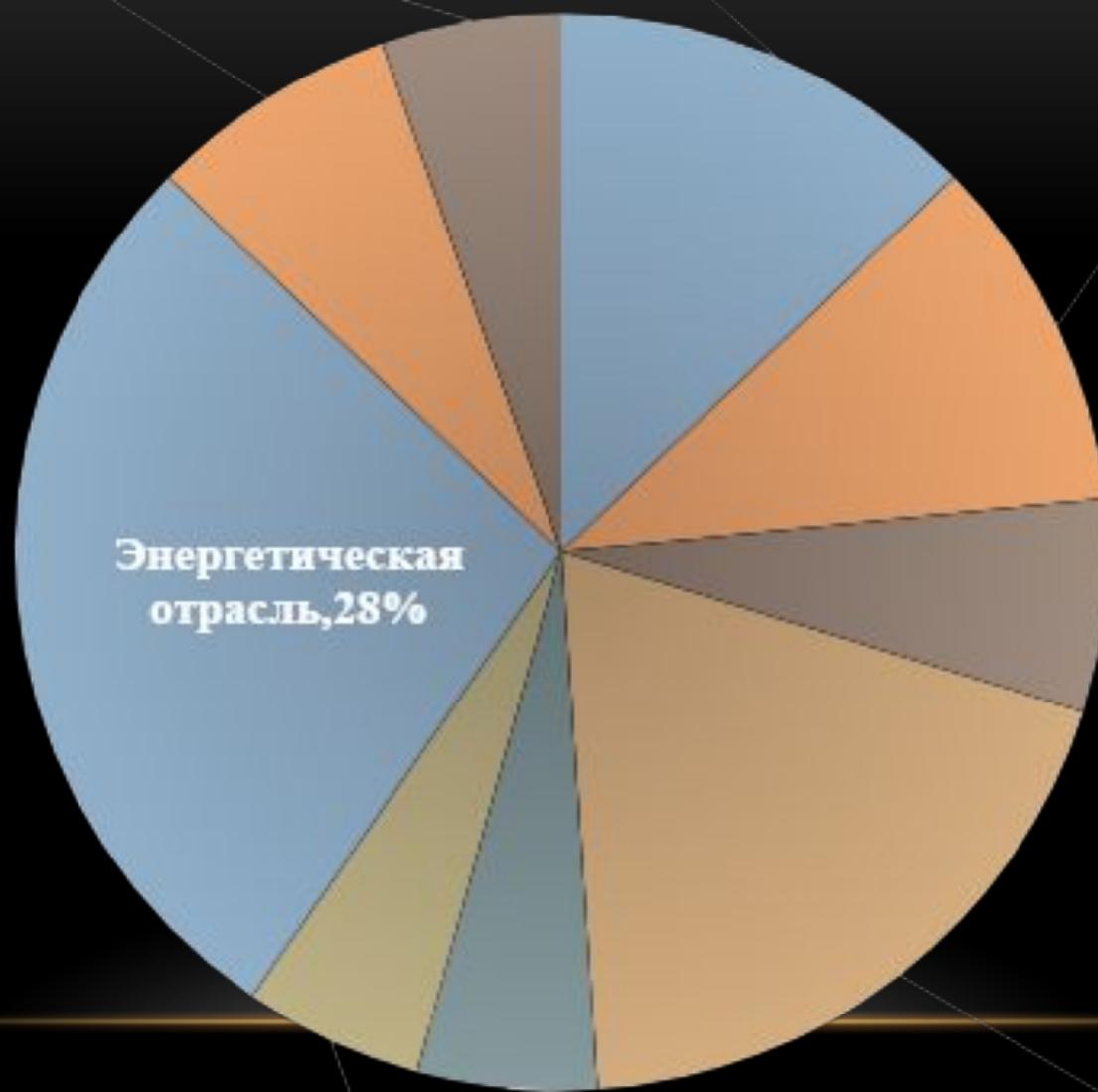
RTSI  
Last -15.07%  
Max +177.64%  
Min -44.40%

# ИНДЕКС ММВБ

- **Индекс Московской Межбанковской Валютной Биржи - это условная величина, которая отображает изменение во времени стоимости акций крупнейших компаний на рынке московской фондовой биржи, так называемых голубых фишек. фондовый индекс ММВБ рассчитывается в режиме реального времени (1 раз в секунду), во время торгов на бирже, т.е. в рабочие дни с понедельника по пятницу, с 10:00 до 18:45 по московскому времени. Пересмотр акций входящих в индекс происходит 1 раз в квартал.**

# Доли различных компаний РТС

Финансово-банковская отрасль, 7%  
транспортные компании, 5%  
Нефтегазовая отрасль, 13%



Потребительский сектор, 11%

Химическая и нефтехимическая отрасль, 6%

Энергетическая отрасль, 28%

Телекоммуникационные  
Машиностроительная отрасль, 5%  
Металлургическая и

№	Код	Наименование	Количество выпущенных акций	Вес акции по сост. на 30.11.201 5
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	23 673 512 900	15,00%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	21 586 948 000	12,84%
3	SBERP	ПАО Сбербанк, ап	1 000 000 000	0,92%
4	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	850 563 255	11,94%
5	MGNT	ПАО "Магнит", ао	94 561 355	7,38%
6	SNGS	ОАО "Сургутнефтегаз", ао	35 725 994 705	3,60%
7	SNGSP	ОАО "Сургутнефтегаз", ап	7 701 998 235	2,86%
8	NVTK	ОАО "НОВАТЭК", ао	3 036 306 000	6,13%
9	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	158 245 476	5,10%

10	VTBR	Банк ВТБ (ПАО), ао	12 960 541 337 338
11	ROSN	ОАО "НК "Роснефть", ао	10 598 177 817
12	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	2 178 690 700
13	TATNP	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ап	147 508 500
14	TRNFP	ОАО "АК "Транснефть", ап	1 554 875
15	MTSS	ПАО "МТС", ао	2 066 413 562
16	CHMF	ПАО "Северсталь", ао	837 718 660
17	MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	2 278 636 493
18	YNDX	Компания с ограниченной ответственностью "Яндекс Н.В.", акции иностранного эмитента	277 161 148
19	MFON	ПАО "МегаФон", ао	620 000 000
20	ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	7 364 965 630
21	RTKM	ПАО "Ростелеком", ао	2 574 914 954
22	RTKMP	ПАО "Ростелеком", ап	209 565 147
23	HYDR	ПАО "РусГидро", ао	386 255 464 890
24	URKA	ПАО "Уралкалий", ао	2 936 015 891
25	PHOR	ОАО "ФосАгро", ао	129 500 000
26	BANE	ПАО АНК "Башнефть", ао	147 846 489
27	BANEP	ПАО АНК "Башнефть", ап	29 788 012
28	AFKS	ОАО АФК "Система", ао	9 650 000 000
29	NLMK	ОАО "НЛМК", ао	5 993 227 240

AGN	ОАО "ММК", ао	11 174 330 000	
ATA	Лента Лтд., ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — Deutsche Bank Luxembourg S.A.)	486 593 730	
RG	ПАО "Группа ЛСР", ао	103 030 215	
АО	ПАО "Интер РАО", ао	104 400 000 000	
KRN	ОАО "Акрон", ао	40 534 000	
LT	ПАО "Аэрофлот", ао	1 110 616 299	
ID	ПАО "М.видео", ао	179 768 227	
XY	ПАО "ДИКСИ Групп", ао	124 750 000	
GRO	РОС АГРО ПЛС, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	120 000 000	
ES	ПАО "ФСК ЕЭС", ао	1 274 665 323 063	
CHE	ПАО "Группа Черкизово", ао	43 963 773	
IST	ПАО "Фармстандарт", ао	37 792 603	
МО	ПАО "Корпорация ВСМПО-АВИСМА", ао	11 529 538	
МК	ПАО "ТМК", ао	993 586 094	
KNC	ПАО "Нижнекамскнефтехим", ао	1 611 256 000	
STI	ПАО "Россети", ао	161 078 853 310	
TLR	ОАО "Мечел", ао	416 270 745	