



Фондовые индексы МосБиржи-РСПП. Новации и практическое применение

Голованев Сергей
Борисович

Директор по развитию индексных
продуктов
22.12.2021

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ, СОВМЕСТНЫЙ ПРОЕКТ РСПП и МОСБИРЖИ



ЭКСПЕРТИЗА
ESG

- ЕЖЕГОДНАЯ ОЦЕНКА ОТЧЕТНОСТИ КРУПНЕЙШИХ РОССИЙСКИХ КОМПАНИЙ
- АНАЛИЗ ESG ПОКАЗАТЕЛЕЙ КОМПАНИЙ
- ФОРМИРОВАНИЕ ГРУПП ЛИДЕРОВ ПО ХАРАКТЕРИСТИКАМ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ



АДМИНИСТРАТОР
РАСЧЕТА

- ФОРМИРОВАНИЕ БАЗ РАСЧЕТА С УЧЕТОМ РЫНОЧНЫХ И ESG ПОКАЗАТЕЛЕЙ
- ЕЖЕДНЕВНЫЙ РАСЧЕТ И ТРАНСЛЯЦИЯ ЗНАЧЕНИЙ ИНДЕКСОВ
- ВЗАИМОДЕЙСТВИЕ С УПРАВЛЯЮЩИМИ КОМПАНИЯМИ

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ. НОВАЦИИ 2021 ГОДА

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ

- ПОВЫШЕНЫ ТРЕБОВАНИЯ К ЛИКВИДНОСТИ ЦЕННЫХ БУМАГ, ВКЛЮЧАЕМЫХ В ИНДЕКСЫ

Введен коэффициент ликвидности, установлено требование к free-float

- ЗАПУСК НОВОЙ ВЕРСИИ ФОНДОВОГО ИНДЕКСА «ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ» - «**ИНДЕКС МОСБИРЖИ – РСПП ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ РОССИЙСКИХ ЭМИТЕНТОВ**»

Новый индекс учитывает требования регулирования деятельности негосударственных пенсионных фондов, что делает возможным инвестирование пенсионных накоплений в корзину бумаг индекса или финансовый продукт, базовым активом которого может выступить новый индикатор

- НАЧАТ РАСЧЕТ ПЕРВОГО В РОССИИ БИРЖЕВОГО ИНДЕКСА ЕВРООБЛИГАЦИЙ В ОБЛАСТИ ESG: «**РСХБ-РСПП-ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ**»

В базу расчета индекса входят еврооблигационные займы российских корпоративных эмитентов, относящихся к Вектору устойчивого развития РСПП

БИРЖЕВЫЕ ФОНДЫ

- РСХБ - Индекс Мосбиржи - РСПП Вектор устойчивого развития, полной доходности, брутто
- Сбер - Ответственные инвестиции
- РСХБ – Российские Еврооблигации ИЭсДжи
- ВТБ – Фонд Устойчивого развития российских эмитентов

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ. КЛЮЧЕВЫЕ ХАРАКТЕРИСТИКИ

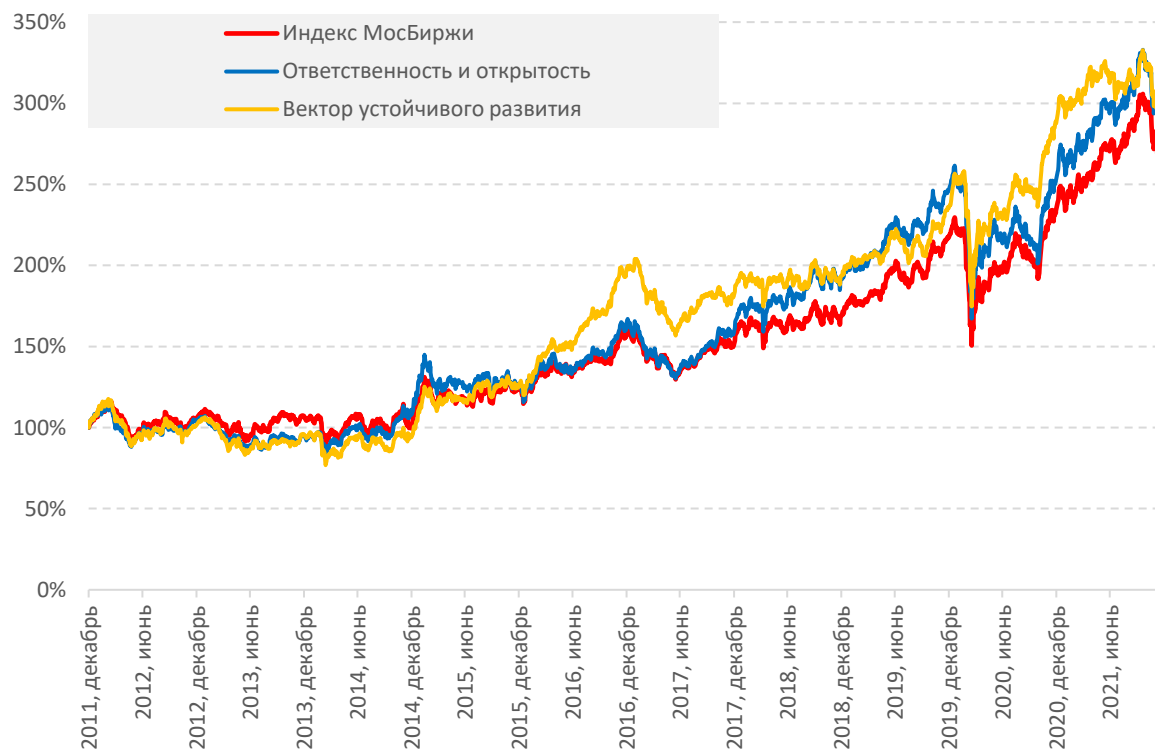
	ОТВЕТСТВЕННОСТЬ И ОТКРЫТОСТЬ	ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ	ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ РОССИЙСКИХ ЭМИТЕНТОВ	ИНДЕКС КОРПОРАТИВНЫХ ЕВРООБЛИГАЦИЙ
Код	MRRT	MRSV / MRSVTR	MRSVR / MRSVRTR	RUEUESG
Активы	Акции российских и иностранных эмитентов, ведущих экономическую деятельность в РФ		Акции российских эмитентов*	Еврооблигации российских и иностранных эмитентов, ведущих экономическую деятельность в РФ
Число ценных бумаг (текущий состав)	29	26	24	17
Взвешивание	По free-float капитализации	Пропорционально ранкингу РСПП	По free-float капитализации	По рыночной капитализации
Максимальный вес	15%	6%**	7%**	10%
Версия полной доходности	Нет	Да	Да	Да
Дата начала расчета	Апрель 2019г.	Апрель 2019г.	Март 2021г.	Март 2021г.

* Не включаются ц/б эмитентов, зарегистрированных за пределами РФ

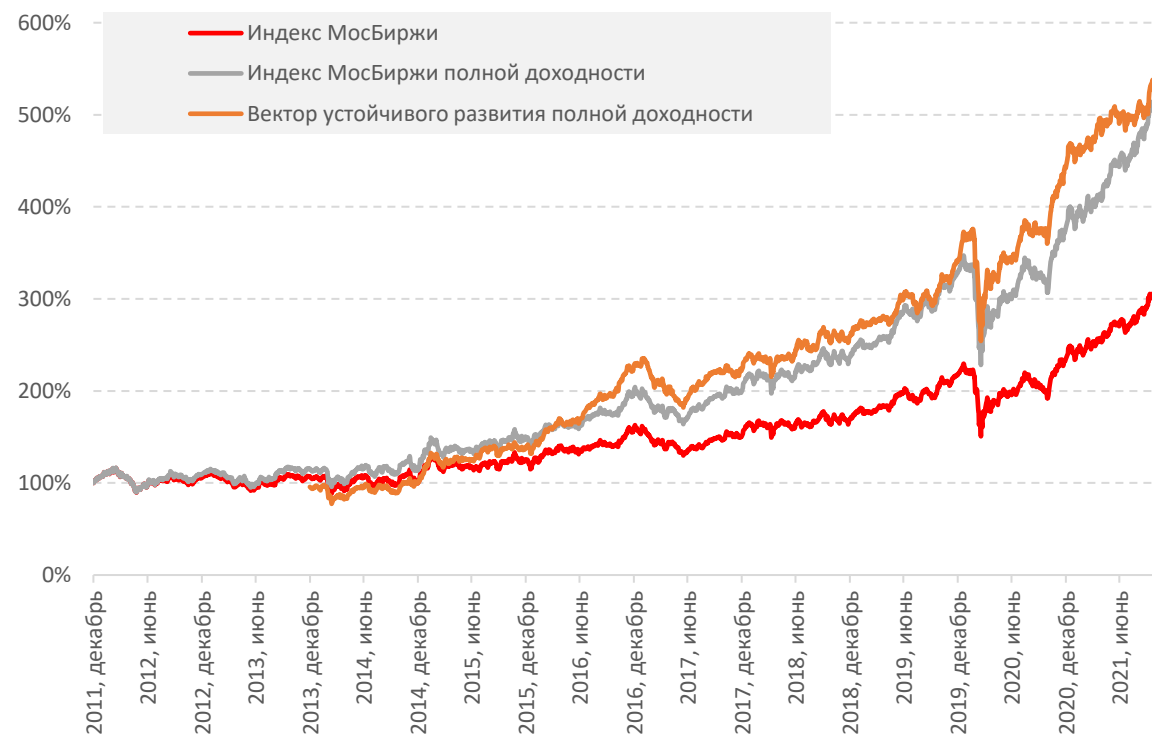
** Фактический вес

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ СРАВНИТЕЛЬНАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ АКЦИЙ

ДИНАМИКА ЦЕНОВЫХ ИНДЕКСОВ



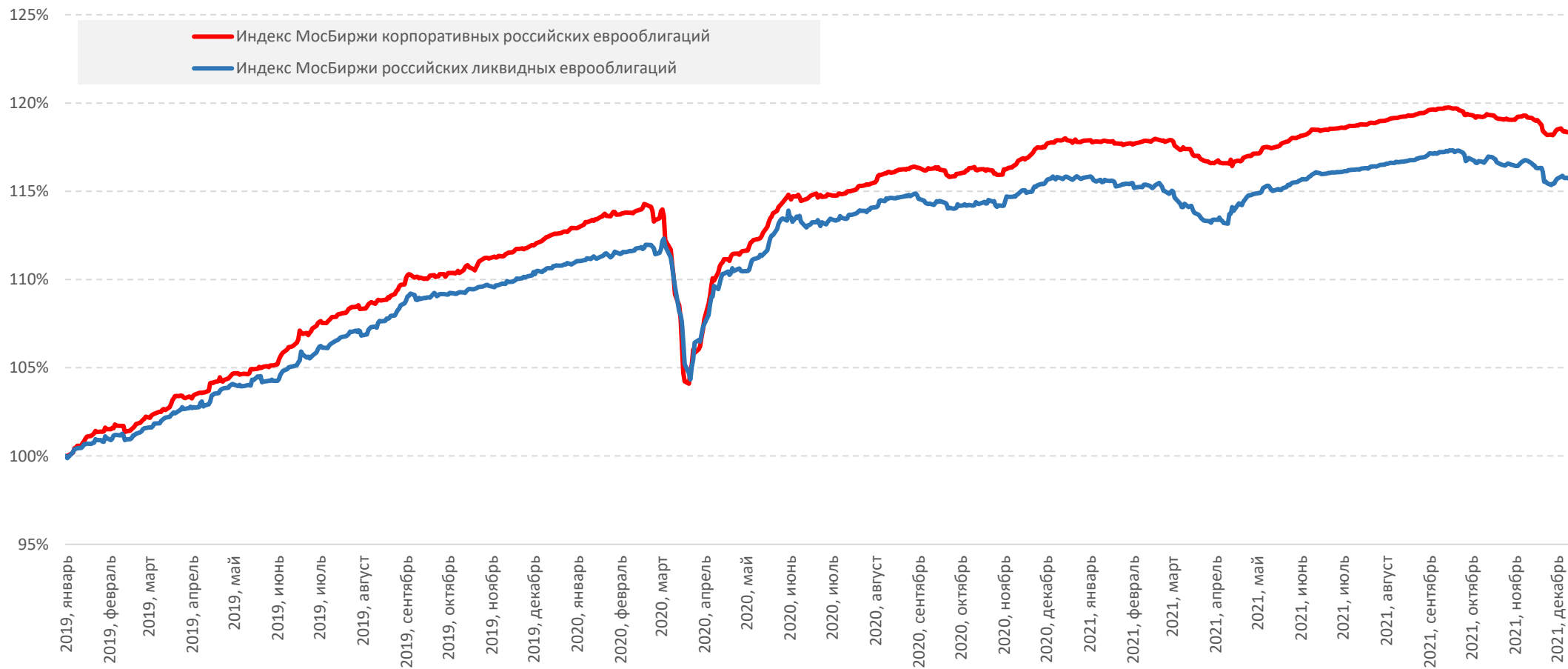
ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ ПОЛНОЙ ДОХОДНОСТИ



ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ

СРАВНИТЕЛЬНАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ ЕВРООБЛИГАЦИЙ

ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ СОВОКУПНОГО ДОХОДА



СПАСИБО!