



Фондовые индексы МосБиржи-РСПП. Итоги 2022 года

Голованев Сергей
Борисович

Директор по развитию индексных
продуктов
14.12.2022

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. 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)	27	25	22	17
Взвешивание	По free-float капитализации	Пропорционально ранкингу РСПП	По free-float капитализации	По рыночной капитализации
Максимальный вес	15%	5,9%**	6,6%**	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

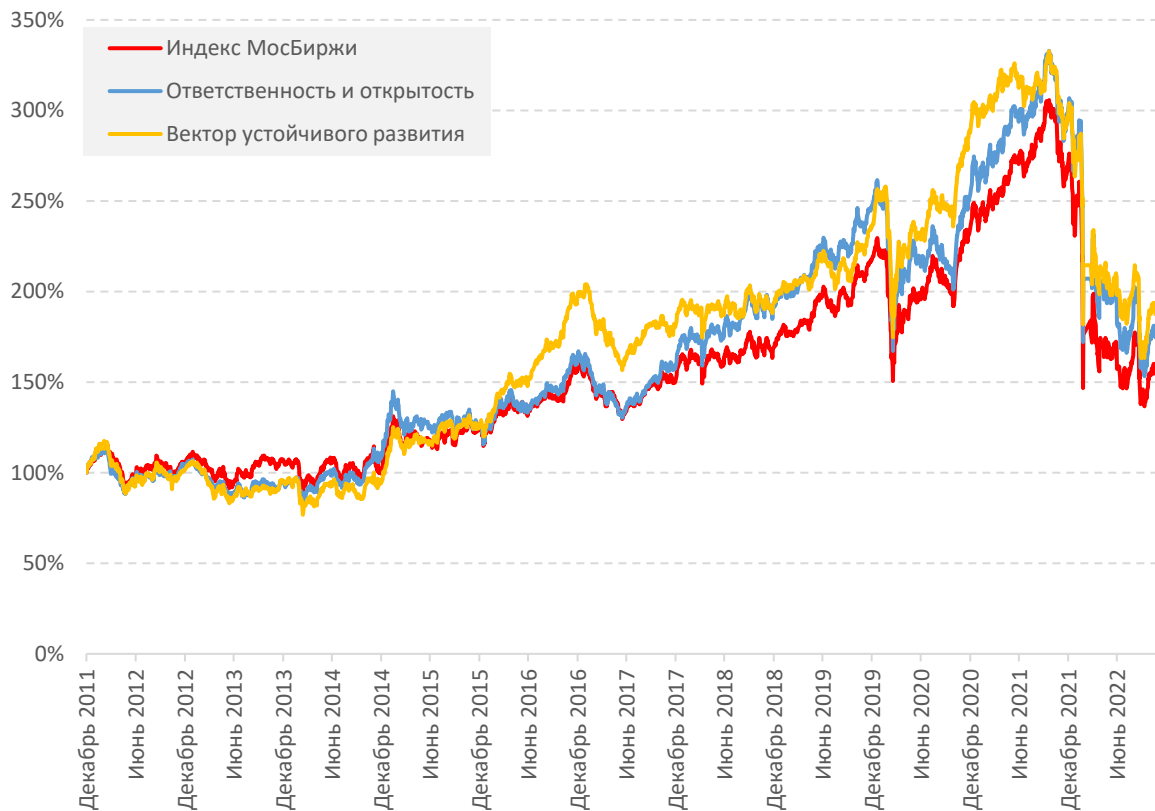
*** Расчет приостановлен в марте 2022

ТИКЕР	НАЗВАНИЕ БИРЖЕВОГО ФОНДА	ДАТА ФОРМИРОВАНИЯ	СЧА, МЛН РУБ.
SBRI	Первая - Фонд Ответственные инвестиции	22.09.2020	930
ESGE	УК ВИМ – Устойчивое развитие российских компаний	10.09.2021	104
ESGR	РСХБ - Индекс Мосбиржи - РСПП Вектор устойчивого развития, полной доходности, брутто	22.06.2020	98
PRIE	РСХБ – Российские Еврооблигации ИЭсДжи	22.04.2021	91*
ИТОГО			1 223

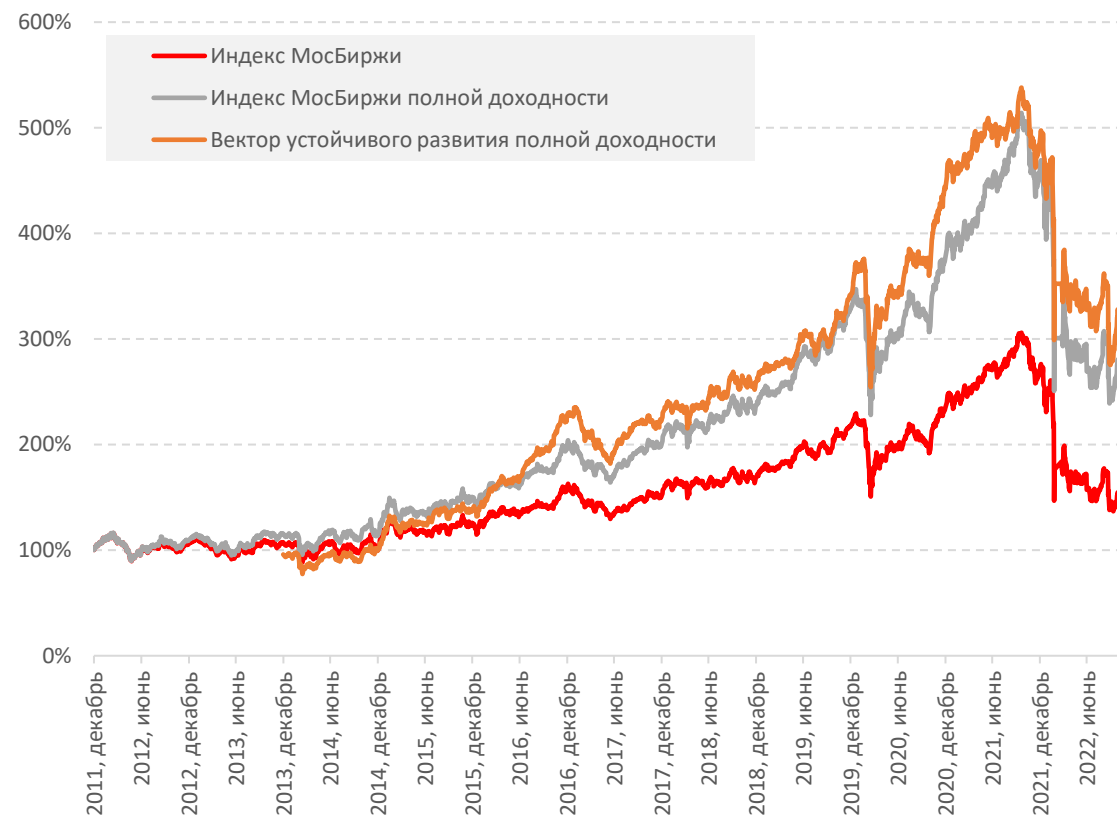
* По состоянию на 25.02.2022

ФОНДОВЫЕ ИНДЕКСЫ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ СРАВНИТЕЛЬНАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ АКЦИЙ

ДИНАМИКА ЦЕНОВЫХ ИНДЕКСОВ



ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ ПОЛНОЙ ДОХОДНОСТИ



ДОХОДНОСТЬ ИНДЕКСОВ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ

ДОХОДНОСТЬ ЦЕНОВЫХ ИНДЕКСОВ

Индексы	Доходность индексов			
	2019	2020	2021	2022*
Ответственность и открытость	29%	3%	18%	-41%
Вектор устойчивого развития	22%	22%	3%	-36%
Вектор устойчивого развития рос. эмитентов	22%	22%	5%	-34%
Индекс МосБиржи	29%	8%	15%	-42%

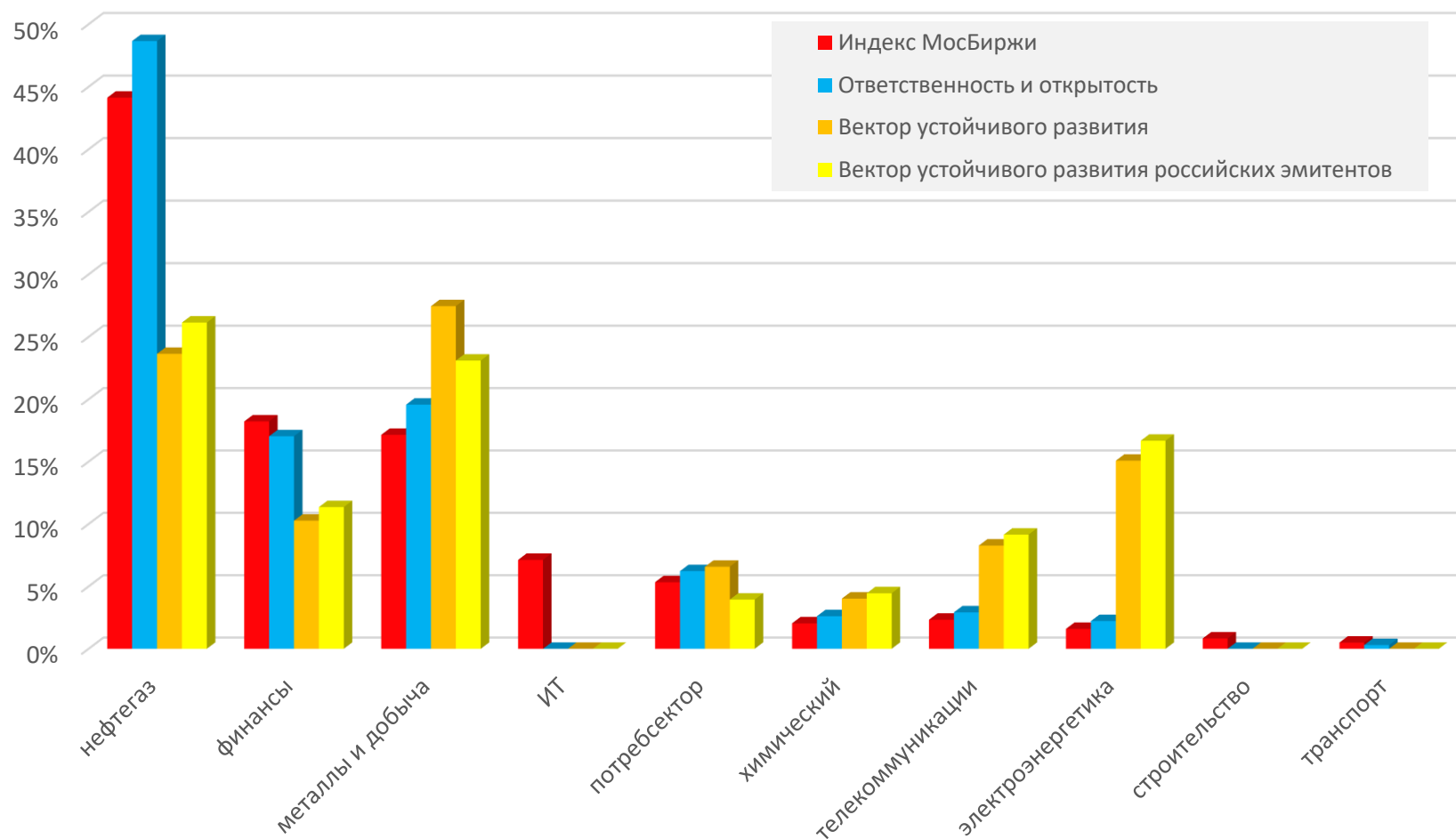
ДОХОДНОСТЬ ИНДЕКСОВ ПОЛНОЙ ДОХОДНОСТИ

Индексы	Доходность индексов			
	2019	2020	2021	2022*
Вектор устойчивого развития TR	31%	30%	10%	-32%
Вектор устойчивого развития рос. эмитентов TR	31%	30%	12%	-30%
Индекс МосБиржи TR	38%	15%	22%	-38%

* - доходность за период с 03.01.2022 по 08.12.2022

ОТРАСЛЕВАЯ ДИВЕРСИФИКАЦИЯ ИНДЕКСОВ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ

ИНДЕКС ВЕКТОР УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ БОЛЕЕ ДИВЕРСИФИЦИРОВАН ПО ОТРАСЛЯМ ПО СРАВНЕНИЮ С ИНДЕКСАМИ, В КОТОРЫХ ВЗВЕШИВАНИЕ ОСУЩЕСТВЛЯЕТСЯ ПО FREE-FLOAT КАПИТАЛИЗАЦИИ



СПАСИБО!