

ИНДЕКС MSCI AUSTRALIA (RUSSIAN) (USD)

Индекс MSCI Australia Index создан для измерения результатов деятельности компаний со средним и высоким уровнем капитализации на австралийском рынке. Основываясь на 71 составляющих, этот индекс охватывает приблизительно 85 % рыночной капитализации акций, находящихся в свободном обращении в Австралии.

Кумулятивная динамика индекса – чистый доход (USD) (Апр 2000 – Апр 2015)



Годовая доходность (%)

Year	MSCI Australia	MSCI World	MSCI ACWI IMI
2014	-3.41	4.94	3.84
2013	4.16	26.68	23.55
2012	22.07	15.83	16.38
2011	-10.95	-5.54	-7.89
2010	14.52	11.76	14.35
2009	76.43	29.99	36.41
2008	-50.67	-40.71	-42.34
2007	28.34	9.04	11.16
2006	30.86	20.07	20.95
2005	16.02	9.49	11.54
2004	30.34	14.72	16.42
2003	49.46	33.11	35.54
2002	-1.34	-19.89	-17.58
2001	1.68	-16.82	-15.65

Динамика индекса – чистая доходность (%) (Апр 30, 2015)

	1 Mo	3 Mo	1 Yr	YTD	ANNUALIZED			
					3 Yr	5 Yr	10 Yr	Since May 31, 1994
MSCI Australia	1.16	6.18	-6.65	4.29	4.87	4.75	8.26	8.60
MSCI World	2.35	6.65	7.41	4.71	13.49	10.51	6.87	7.02
MSCI ACWI IMI	2.75	7.06	7.34	5.40	12.37	9.71	7.29	6.96

Фундаментальные показатели

Div Yld (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
4.43	16.44	16.17	2.04
2.37	19.38	16.73	2.30
2.31	19.40	16.41	2.16

Характеристики риска и доходности индекса (Апр 30, 2015)

	Turnover (%) ¹	ANNUALIZED STD DEV (%) ²			SHARPE RATIO ^{2, 3}			Since May 31, 1994	MAXIMUM DRAWDOWN	
		3 Yr	5 Yr	10 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr	(%)	Period YYYY-MM-DD	
MSCI Australia	1.25	18.94	22.82	24.40	0.34	0.31	0.38	na	65.60	2007-11-01—2009-03-09
MSCI World	2.35	10.47	14.20	16.02	1.25	0.76	0.39	na	57.82	2007-10-31—2009-03-09
MSCI ACWI IMI	2.86	10.56	14.59	16.78	1.14	0.70	0.40	0.32	58.59	2007-10-31—2009-03-09

¹ Last 12 months

² Based on monthly net returns data

³ Based on BBA LIBOR 1M

Расчет индекса MSCI Australia и MSCI World начался 31 декабря 1969 года. Расчет ACWI IMI ведется с 31 мая 2007 года. Данные, полученные до начала расчета индекса, являются данными, основанными на ретроспективном анализе (т. е. учитываются показатели, указывающие на то, как индекс мог бы развиваться в прошлом).

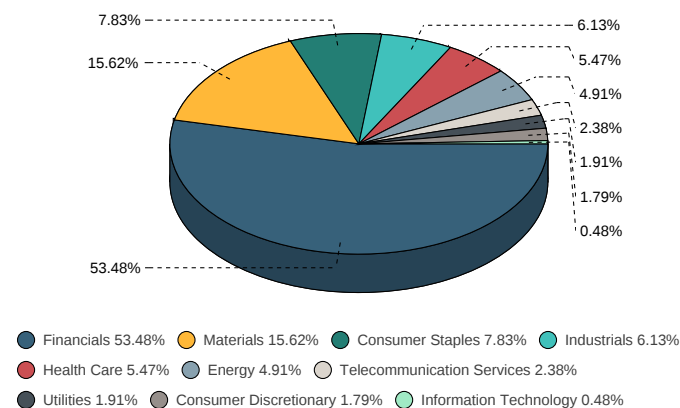
Характеристики индекса

MSCI Australia	
Number of Constituents	71
Mkt Cap (USD Millions)	
Index	966,092.08
Largest	113,648.33
Smallest	1,387.93
Average	13,606.93
Median	5,938.83

10 основных составляющих

	Mkt Cap (USD Billions)	Index Wt. (%)	Sector	Sector Wt. (%)
COMMONWEALTH BANK OF AUS	113.65	11.76	Financials	22.0
WESTPAC BANKING	89.41	9.25	Financials	17.3
BHP BILLITON (AU)	80.99	8.38	Materials	53.7
ANZ BANKING GROUP	73.90	7.65	Financials	14.3
NATIONAL AUSTRALIA BANK	68.63	7.10	Financials	13.3
WESFARMERS	38.73	4.01	Cons Staples	51.2
CSL	34.07	3.53	Health Care	64.5
WOOLWORTHS LTD	29.37	3.04	Cons Staples	38.8
TELSTRA CORP	21.03	2.18	Telecom Srvcs	91.5
WOODSIDE PETROLEUM	20.50	2.12	Energy	43.2
Total	570.28	59.03		

Веса секторов



Методика расчета индекса

Индекс рассчитывается по методике [MSCI Global Investable Market Indexes \(GIMI\)](#) – это полный и последовательный подход, дающий возможность проводить сравнения на любом уровне капитализации, в секторных и стилевых сегментах, а также комбинациях как в мировом масштабе, так и на региональном уровне. Целью этой методики является предоставление подробной информации об инвестиционных возможностях, при этом делается акцент на ликвидность, инвестиционную привлекательность и воспроизводимость индекса. Проводится ежеквартальный пересмотр значений индекса – в феврале, мае, августе и ноябре – с целью своевременного отражения изменений на соответствующем фондовом рынке и предотвращения чрезмерного оборота акций. Во время полугодовых пересмотров в мае и ноябре производится перебалансировка индекса и пересчет процентного порога для расчета сегментов индекса по компаниям крупной, средней и малой капитализации.

ABOUT MSCI

For more than 40 years, MSCI's research-based indexes and analytics have helped the world's leading investors build and manage better portfolios. Clients rely on our offerings for deeper insights into the drivers of performance and risk in their portfolios, broad asset class coverage and innovative research. Our line of products and services includes indexes, analytical models, data, real estate benchmarks and ESG research. MSCI serves 98 of the top 100 largest money managers, according to the most recent P&I ranking. For more information, visit us at www.msci.com.

The information contained herein (the "Information") may not be reproduced or disseminated in whole or in part without prior written permission from MSCI. The Information may not be used to verify or correct other data, to create indexes, risk models, or analytics, or in connection with issuing, offering, sponsoring, managing or marketing any securities, portfolios, financial products or other investment vehicles. Historical data and analysis should not be taken as an indication or guarantee of any future performance, analysis, forecast or prediction. None of the Information or MSCI index or other product or service constitutes an offer to buy or sell, or a promotion or recommendation of, any security, financial instrument or product or trading strategy. Further, none of the Information or any MSCI index is intended to constitute investment advice or a recommendation to make (or refrain from making) any kind of investment decision and may not be relied on as such. The Information is provided "as is" and the user of the Information assumes the entire risk of any use it may make or permit to be made of the Information. NONE OF MSCI INC. OR ANY OF ITS SUBSIDIARIES OR ITS OR THEIR DIRECT OR INDIRECT SUPPLIERS OR ANY THIRD PARTY INVOLVED IN THE MAKING OR COMPILING OF THE INFORMATION (EACH, AN "MSCI PARTY") MAKES ANY WARRANTIES OR REPRESENTATIONS AND, TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, EACH MSCI PARTY HEREBY EXPRESSLY DISCLAIMS ALL IMPLIED WARRANTIES, INCLUDING WARRANTIES OF MERCHANTABILITY AND FITNESS FOR A PARTICULAR PURPOSE. WITHOUT LIMITING ANY OF THE FOREGOING AND TO THE MAXIMUM EXTENT PERMITTED BY LAW, IN NO EVENT SHALL ANY OF THE MSCI PARTIES HAVE ANY LIABILITY REGARDING ANY OF THE INFORMATION FOR ANY DIRECT, INDIRECT, SPECIAL, PUNITIVE, CONSEQUENTIAL (INCLUDING LOST PROFITS) OR ANY OTHER DAMAGES EVEN IF NOTIFIED OF THE POSSIBILITY OF SUCH DAMAGES. The foregoing shall not exclude or limit any liability that may not be by applicable law be excluded or limited.

© 2015 MSCI Inc. All rights reserved.