

ИНДЕКС MSCI USA (RUSSIAN) (USD)

Индекс MSCI USA Index отражает динамику акций компаний высокой и средней капитализации на фондовом рынке США. Основываясь на 627 составляющих, этот индекс охватывает приблизительно 85 % рыночной капитализации акций, находящихся в свободном обращении в США.

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



Годовая доходность (%)

Year	MSCI USA	MSCI World	MSCI ACWI IMI
2014	12.69	4.94	3.84
2013	31.79	26.68	23.55
2012	15.33	15.83	16.38
2011	1.36	-5.54	-7.89
2010	14.77	11.76	14.35
2009	26.25	29.99	36.41
2008	-37.57	-40.71	-42.34
2007	5.44	9.04	11.16
2006	14.67	20.07	20.95
2005	5.14	9.49	11.54
2004	10.14	14.72	16.42
2003	28.41	33.11	35.54
2002	-23.09	-19.89	-17.58
2001	-12.39	-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 USA	0.88	5.12	12.52	2.12	16.05	13.73	7.82	9.10
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 Ytd (%)	P/E	P/E Fwd	P/BV
1.99	20.08	17.39	2.88
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 (%)	Period YYYY-MM-DD
		3 Yr	5 Yr	10 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr			
MSCI USA	2.56	9.54	13.07	14.79	1.60	1.04	0.47	na	55.36	2007-10-09—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

¹Last 12 months

²Based on monthly net returns data

³Based on BBA LIBOR 1M

Расчет индекса MSCI USA 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).

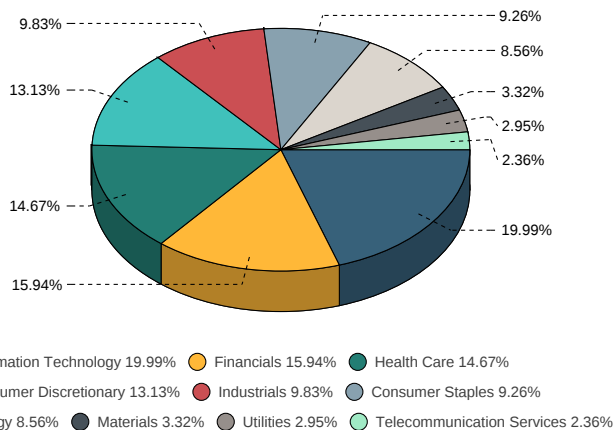
Характеристики индекса

MSCI USA	
Number of Constituents	627
Mkt Cap (USD Millions)	
Index	19,495,783.66
Largest	733,984.73
Smallest	2,295.17
Average	31,093.75
Median	14,058.75

10 основных составляющих

	Mkt Cap (USD Billions)	Index Wt. (%)	Sector	Sector Wt. (%)
APPLE	733.98	3.76	Info Tech	18.8
MICROSOFT CORP	380.89	1.95	Info Tech	9.8
EXXON MOBIL CORP	369.97	1.90	Energy	22.2
JOHNSON & JOHNSON	277.67	1.42	Health Care	9.7
GENERAL ELECTRIC CO	271.94	1.39	Industrials	14.2
WELLS FARGO & CO	271.55	1.39	Financials	8.7
JPMORGAN CHASE & CO	236.48	1.21	Financials	7.6
PROCTER & GAMBLE CO	214.85	1.10	Cons Staples	11.9
PFIZER	213.78	1.10	Health Care	7.5
CHEVRON CORP	209.95	1.08	Energy	12.6
Total	3,181.06	16.32		

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.