



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Московская биржа сформировала базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 20 декабря 2019 года, а также установила значения коэффициентов free-float для ценных бумаг ряда эмитентов.

В базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включаются депозитарные расписки TCS Group Holding, исключаются обыкновенные акции ПАО НК "РуссНефть", ПАО "САФМАР" и ПАО "М.видео".

В лист ожидания на исключение из состава Индекса МосБиржи и Индекса РТС войдут депозитарные расписки Ленты Лтд.

База расчета Индекса голубых фишек останется без изменений.

В базу расчета Индекса акций широкого рынка будут включены обыкновенные акции ПАО "Ашинский металлургический завод", ПАО "ГЛОБАЛТРАК МЕНЕДЖМЕНТ", а также депозитарные расписки TCS Group Holding. Покинут индекс обыкновенные акции ПАО "ГАЗ" и привилегированные акции ПАО "Химпром".

Базу расчета Индекса средней и малой капитализации дополняют обыкновенные акции ПАО НК "РуссНефть".

В состав Индекса потребительского сектора войдут обыкновенные акции ПАО "Аптечная сеть 36,6". Депозитарные расписки TCS Group Holding будут включены в состав Индекса финансов, а обыкновенные акции ПАО " ГЛОБАЛТРАК МЕНЕДЖМЕНТ" - в состав Индекса транспорта.

В базу расчета Индекса МосБиржи 10 войдут обыкновенные акции ПАО "Сургутнефтегаз" и акции иностранного эмитента Яндекс Н.В., им уступят место обыкновенные акции ПАО "Московская Биржа" и привилегированные акции ПАО "Сбербанк".

Из базы расчета Индекса МосБиржи инноваций исключаются обыкновенные акции ПАО "ОАК".

Обновлены корзины индексов активов пенсионных накоплений.

Обновление параметров баз расчета индексов МосБиржи – РСПП будет синхронизировано с пересмотром индексных корзин и вступит в силу с 27 января 2020 года.

Сводная таблица изменений в списках индексов Московской Биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи, Индекс РТС	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент - JPMorgan Chase Bank, N.A.)	ПАО "М.видео", ао ПАО НК "РуссНефть", ао ПАО "САФМАР", ао
Индекс широкого рынка	ПАО "Ашинский металлургический завод", ао	ПАО "ГАЗ", ао
	ПАО "ГЛОБАЛТРАК МЕНЕДЖМЕНТ", ао	ПАО "Химпром", ап
	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент - JPMorgan Chase Bank, N.A.)	
Индекс малой и средней капитализации	ПАО НК "РуссНефть", ао	
Индекс потребительского сектора	ПАО "Аптечная сеть 36,6", ао	
Индекс финансов	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент - JPMorgan Chase Bank, N.A.)	
Индекс транспорта	ПАО "ГЛОБАЛТРАК МЕНЕДЖМЕНТ", ао	
Индекс МосБиржи 10	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	ПАО Московская Биржа, ао
	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	ПАО Сбербанк, ап
Индекс МосБиржи инноваций		ПАО "ОАК", ао



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Для ряда ценных бумаг, входящих в новые списки индексов Московской Биржи, была произведена переоценка коэффициентов, определяющих долю акций в свободном обращении (free-float). В индексах будет учитываться количество акций, находящееся в обращении на бирже по состоянию на 29 ноября 2019г. для следующих ценных бумаг произойдет изменение этих параметров:

Сводная таблица изменений количества акций, учитываемого в индексах Московской биржи и листах ожидания, а также коэффициентов free-float

Код	Наименование	Действующее количество акций	Новое количество акций	Действующий free-float	Новый free-float
BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	19 400 000	--	26%	21%
СВОМ	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК", ао	27 079 709 866	29 829 709 866	18%	20%
ENPL	МКПАО "ЭН+ ГРУП", ДР (эмитент - Citibank N.A.)	638 848 896	--	13%	10%
FTRE	ПАО "Финансовая группа БУДУЩЕЕ", ао	50 293 125	--	10%	2%
KBTK	ПАО "КТК", ао	99 258 355	--	34%	6%
KRKNP	ПАО "Саратовский НПЗ", ап	249 337	--	35%	31%
MRKY	ПАО "МРСК Юга", ао	69 039 057 177	82 039 595 425	35%	29%
MVID	ПАО "М.видео", ао	179 768 227	--	17%	19%
NLMK	ПАО "НЛМК", ао	5 993 227 240	--	16%	19%
PLZL	ПАО "Полюс", ао	133 561 119	--	16%	21%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	470 183 404	470 188 201	45%	--
PMSB	ПАО "Пермская энергосбытовая компания", ао	36 210 960	--	--	7%
RASP	ПАО "Распадская", ао	703 191 442	--	16%	12%
RAVN	Рейвен Проперти Груп Лимитед, акции иностранного эмитента	600 494 050	489 727 591	22%	25%
RNFT	ПАО НК "РуссНефть", ао	294 120 000	--	9%	11%
TCSG	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент - JPMorgan Chase Bank, N.A.)	--	119 291 268	--	89%
TGKD	ПАО "Квадра", ао	1 912 495 577 759	--	14%	17%
TNSE	ПАО Группа компаний "ТНС энерго", ао	13 668 239	--	4%	1%
WTCM	ПАО "Центр международной торговли", ао	1 083 000 000	--	8%	7%
YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	292 567 655	292 597 655	96%	--

Обстоятельства, учтенные при определении коэффициентов free-float:

1. BELU. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента и существенном факте, а также раскрытой в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 79% акций.
2. СВОМ. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 60% акций.
3. ENPL. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
4. FTRE. На основании информации, опубликованной в существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 98% акций.

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

5. KBTK. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, а также в существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 94% акций.
6. KRKNP. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 69% акций.
7. MRKY. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 71% акций.
8. MVID. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 81% акций.
9. NLMK. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 81% акций.
10. PLZL. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 79% акций.
11. PMSB. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 93% акций.
12. RASP. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 88% акций.
13. RAVN. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 75% акций.
14. RNFT. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 89% акций.
15. TCSG. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 11% акций.
16. TGKD. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 83% акций.
17. TNSE. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 99% акций.
18. WTCM. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 93% акций.

С 20 декабря 2019г. в листах ожидания на включение и исключение из индексов Московской биржи будут находиться следующие ценные бумаги:

Листы ожидания на включение в индексы Московской Биржи

№	Код	Наименование	Индекс
1	BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	Индекс широкого рынка
2	MAGE	ПАО энергетики и электрификации "Магаданэнерго", ао	
3	NKSH	ПАО "Нижнекамскшина", ао	
4	UNKL	ПАО "Южно-Уральский никелевый комбинат", ао	
5	VRSB	ПАО "ТНС энерго Воронеж", ао	
6	ISKJ	ПАО "Институт Стволовых Клеток Человека", ао	
7	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	
8	RUSP	ПАО "Русполимет", ао	

Лист ожидания на исключение из индексов Московской Биржи

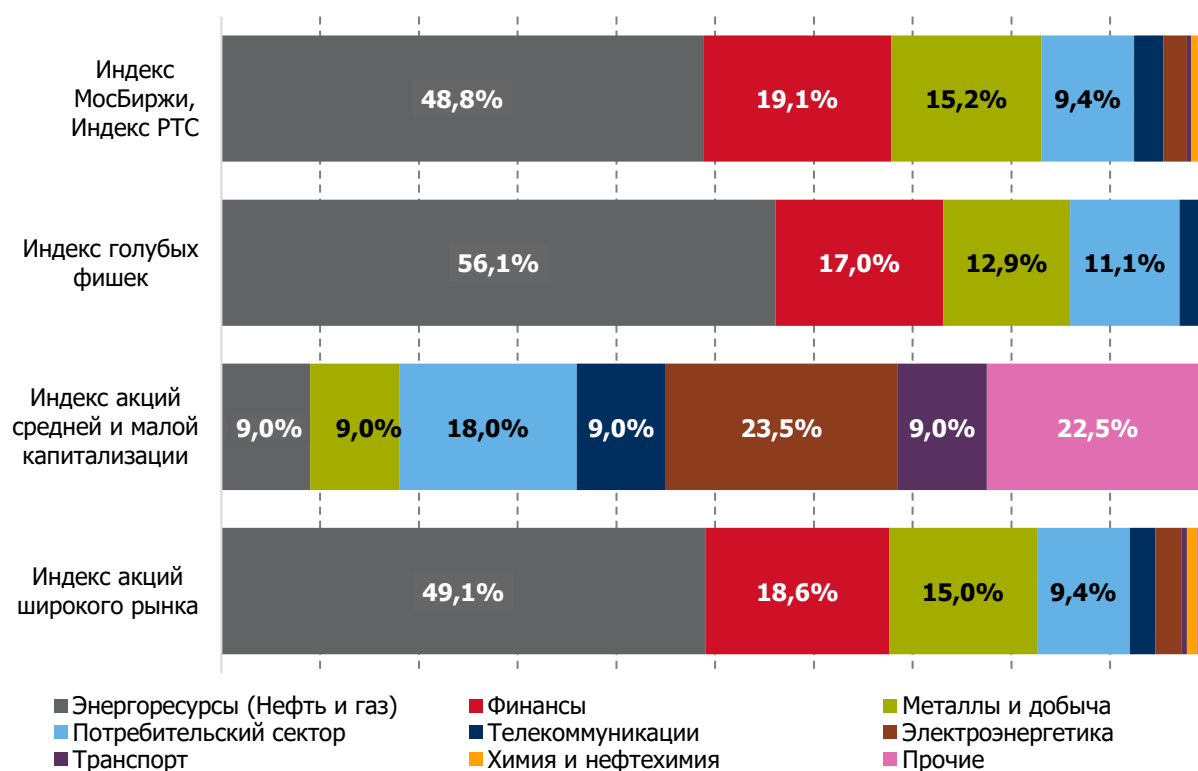
№	Код	Наименование	Индекс
1	LNTA	Лента Лтд., ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — Deutsche Bank Luxembourg S.A.)	Индекс МосБиржи, Индекс РТС
2	SELGP	ПАО "Селигдар", ап	Индекс широкого рынка

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 29.11.2019г.)

Индекс	Число бумаг (эмитентов)	Суммарная капитализация, млн. долл.	Суммарная капитализация, учитываемая в индексе, млн. долл.	Капитализация акций, входящих в новый состав индекса, млн. долл.		
				Средняя	Макс.	Мин.
Индекс МосБиржи, Индекс РТС	39 (35)	637 775	176 504	16 353	94 842	1 088
Индекс голубых фишек	15	534 624	143 477	35 642	94 842	5 205
Индекс акций средней и малой капитализации	27 (25)	42 336	2 989	1 568	3 963	184
Индекс широкого рынка	104 (88)	683 511	219 552	6 835	94 842	12
Индекс МосБиржи инновации	7 (6)	1 066	17	152	966	3

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 29.11.2019г.)



В индексах МосБиржи и РТС наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансов – 48,8% и 19,1% соответственно. Так же выделяется металлургия (15,2%) и потребительский сектор (9,4%).

В Индексе голубых фишек на долю сектора энергоресурсов (нефти и газа) приходится 56,1%. Значительный вес занимают финансовый сектор (17,0%), металлургия (12,9%), а также потребительский сектор – 11,1%.

В базе расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленным сектором является электроэнергетика – 23,5%. Существенный вес в индексе занимает потребительский сектор (18,0%). Транспортные и телекоммуникационные компании, а также компании секторов металлургия и энергоресурсы занимают в индексе равные доли в размере 9,0%. К группе «прочие» были отнесены холдинги, а также компании, представляющие секторы промышленность и недвижимость. Их доля составляет 22,5% в индексе. Методикой не предусмотрено включение в состав индекса ценных бумаг финансового сектора.



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

В Индексе акций широкого рынка наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансов – 49,1% и 18,6% соответственно. Также выделяется сектор металлов и добычи (15,0%).

Более подробно с отраслевым классификатором всех эмитентов акций, входящих в индексы Московской Биржи, Вы можете ознакомиться на [соответствующей странице](#).

Индекс МосБиржи и Индекс РТС

Наибольший вес в основных индексах Московской Биржи – 15,00% занимают обыкновенные акции ПАО "Газпром". На второй позиции акции ПАО "ЛУКОЙЛ" с весом 14,10%, далее – ПАО "Сбербанк". Четвертую и пятую позиции занимают соответственно ПАО "ГМК "Норильский никель" и ПАО "НОВАТЭК".

Крупнейшие компании в индексах МосБиржи и РТС

№	Код	Наименование	Вес (на 29.11.2019)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	15,00%
2	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	14,10%
3	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,79%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	6,10%
5	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	4,81%
6	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	4,81%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,53%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	4,02%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	3,17%
10	MTSS	ПАО "МТС", ао	2,41%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 20 декабря 2019г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).

Индекс голубых фишек

Весы акций в индексе по состоянию на 29.11.2019г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 29.11.2019)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	18,45%
2	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	17,34%
3	SBER	ПАО Сбербанк, ао	16,97%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	7,50%
5	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	5,91%
6	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	5,91%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	5,57%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	4,94%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	3,90%
10	MTSS	ПАО "МТС", ао	2,97%
11	FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В.и, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	2,59%
12	MGNT	ПАО "Магнит", ао	2,58%
13	ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	2,11%
14	CHMF	ПАО "Северсталь", ао	1,65%
15	NLMK	ПАО "НЛМК", ао	1,60%

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

С базой расчета Индекса голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 20 декабря 2019г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).

Индексы акций широкого рынка и средней и малой капитализации

С полным составом базы расчета Индекса акций широкого рынка, вступающей в силу с 20 декабря 2019г., Вы можете ознакомиться [на соответствующей странице](#), состав Индекса акций средней и малой капитализации также представлен [на сайте](#).

Индекс МосБиржи инноваций

Весы акций в индексе по состоянию на 29.11.2019г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 29.11.2019)
1	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	30,00%
2	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	15,52%
3	GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	14,37%
4	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	13,55%
5	DZRDP	ОАО "Донской завод радиодеталей", ап	11,29%
6	NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	9,63%
7	DZRD	ОАО "Донской завод радиодеталей", ао	5,63%

С базой расчета Индекса МосБиржи инноваций и ее параметрами, вступающими в силу с 20 декабря 2019г., Вы можете ознакомиться на [соответствующей странице](#).

ПАО Московская Биржа
Департамент индексов и биржевой информации
Россия, 125009 г. Москва, Большой Кисловский пер., д.13
Телефон: +7 (495) 363-3232
Факс: +7 (495) 705-9622
E-mail: index@moex.com