МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Московская биржа сформировала базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 20 марта 2020 года, а также установила значения коэффициентов free-float для ценных бумаг ряда эмитентов.

Из базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС исключаются депозитарные расписки Ленты Лтд. В лист ожидания на включение в основные индексы войдут обыкновенные акции "Эн+ Груп" и депозитарные расписки QIWI PLC.

В базу расчета Индекса голубых фишек войдут обыкновенные акции ПАО "Полюс", покинут индекс обыкновенные акции ПАО "Северсталь".

База расчета Индекса акций широкого рынка изменится за счет исключения из состава привилегированных акций ПАО "Селигдар" и включения депозитарных расписок ЭТАЛОН ГРУП ПИЭЛСИ. Депозитарные расписки МКПАО "Эн+ Груп" будут заменены обыкновенными акциями данного эмитента.

Базу расчета Индекса средней и малой капитализации дополнят обыкновенные акции ПАО "Акрон" и ПАО "Аптечная сеть 36,6".

Обыкновенные акции ПАО НК "РуссНефть" и ПАО "ТМК" покинут Индекс нефти и газа.

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

В базу расчета Индекса МосБиржи инноваций включаются обыкновенные акции ПАО "ОАК".

Обновлены корзины индексов активов пенсионных накоплений и параметры баз расчета индексов МосБиржи - РСПП.

Сводная таблица изменений в списках индексов Московской Биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи, Индекс РТС		Лента Лтд., ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — Deutsche Bank Luxembourg S.A.)
Индекс широкого рынка	ETALON GROUP PLC, ДР иностранного эмитента	ПАО "Селигдар", ап
Индекс голубых фишек	ПАО "Полюс", ао	ПАО "Северсталь", ао
Индекс малой и средней капитализации	ПАО "Акрон", ао ПАО "Аптечная сеть 36,6", ао	
Индекс нефти и газа		ПАО "НК "РуссНефть", ао ПАО "ТМК", ао
Индекс МосБиржи 10	ПАО "Магнит", ао ПАО "РусГидро", ао	ПАО "Сургутнефтегаз", ап Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента
Индекс МосБиржи инноваций	ПАО "ОАК", ао	

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 28 февраля 2020г. для следующих ценных бумаг произойдет изменение этих параметров:

МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

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
AKRN	ПАО Акрон, ао	40 534 000	--	12%	10%
BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	19 400 000	--	21%	18%
DSKY	ПАО "Детский мир", ао	739 000 000	--	34%	55%
ETLN	ETALON GROUP PLC, ДР	--	267 486 815	--	62%
GAZP	ПАО "Газпром", ао	23 673 512 900	--	46%	50%
LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	715 000 000	692 865 762	54%	55%
MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	2 276 401 458	--	58%	63%
MTLR	ПАО "Мечел", ао	416 270 745	--	50%	47%
MVID	ПАО "М.видео", ао	179 768 227	--	19%	10%
NKNCP	ПАО "Нижнекамскнефтехим", ап	218 983 750	--	56%	67%
OGKB	ПАО "ОГК-2", ао	110 441 160 870	--	23%	19%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	470 188 201	470 230 200	45%	--
ROLO	ПАО "Русолово", ао	3 000 100 000	--	8%	5%
RSTIP	ПАО "Российские сети", ап	2 075 149 384	--	59%	56%
SELGP	ПАО "Селигдар", ап	150 000 000	--	16%	10%
UWGN	ПАО "НПК ОВК", ао	115 996 689	--	13%	12%
WTCMP	ОАО ЦМТ, ап	162 000 000	--	59%	40%
YNDX	Яндекс Н.В., ао	292 597 655	293 527 656	96%	--

Обстоятельства, учтенные при определении коэффициентов free-float:

1. AKRN. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц и существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
2. BELU. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 82% акций.
3. DSKY. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента и раскрытой в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 45% акций.
4. ETLN. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 38% акций.
5. GAZP. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 50% акций.
6. LKOH. На основании информации, опубликованной в годовом и ежеквартальном отчетах, во владении стратегических инвесторов находится не менее 45% акций.
7. MOEX. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента и в списке аффилированных лиц, а также в существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 37% акций.
8. MTLR. На основании информации, опубликованной на официальном сайте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 53% акций.
9. MVID. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
10. NKNCP. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 33% акций.
11. OGKB. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных, во владении стратегических инвесторов находится не менее 81% акций.
12. ROLO. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 95% акций.
13. RSTIP. На основании информации, полученной от эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 44% акций.

14. SELGP. На основании информации, полученной от эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
15. UWGN. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 88% акций.
16. WTCMP. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 60% акций.

С 20 марта 2020г. в листах ожидания на включение и исключение из индексов Московской биржи будут находиться следующие ценные бумаги:

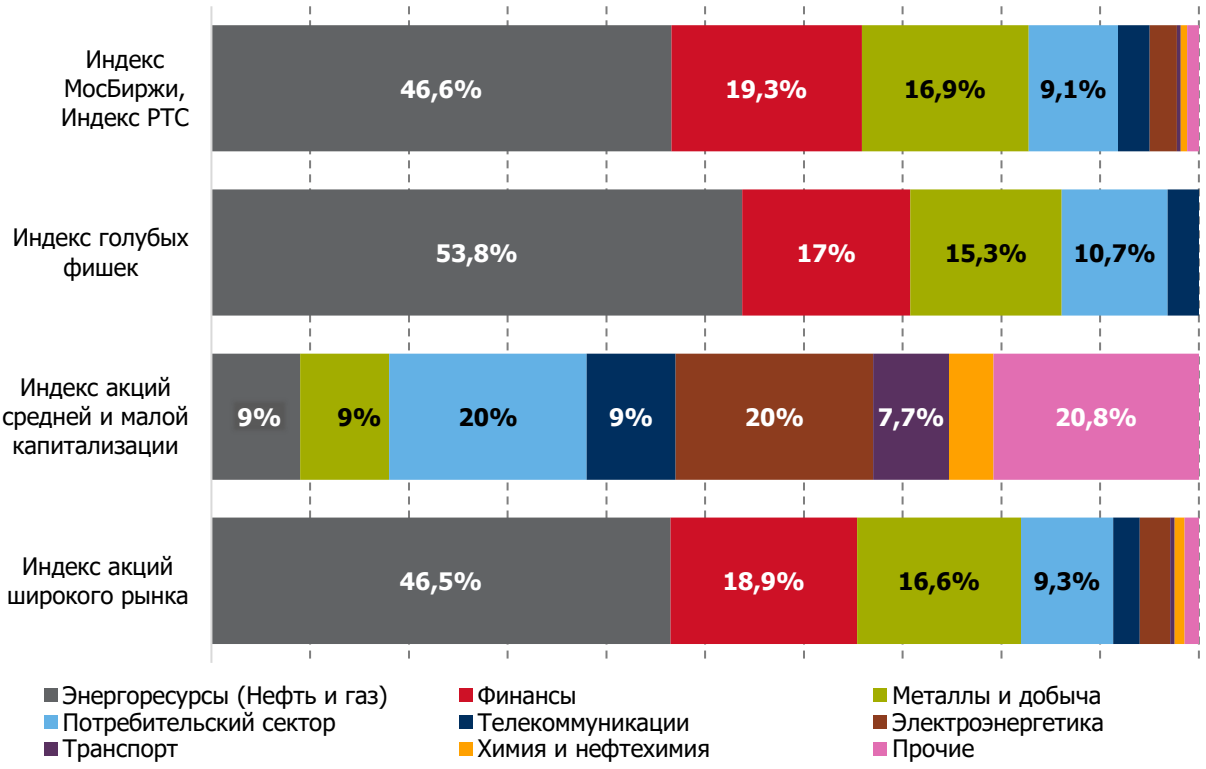
Листы ожидания на включение в индексы Московской Биржи

№	Код	Наименование	Индекс
1	BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	Индекс широкого рынка
2	KOGK	ПАО "Коршуновский горно-обогатительный комбинат", ао	
3	KZOS	ПАО "Казаньоргсинтез", ао	
4	NFAZ	ПАО "Нефтекамский автозавод", ао	
5	SLEN	ПАО энергетики и электрификации "Сахалинэнерго", ао	
6	VZRZP	ПАО Банк "Возрождение", ап	
7	ENPG	EN+ Групп, ао	Индекс МосБиржи, Индекс РТС
8	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 28.02.2020г.)

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	38 (35)	566 432	166 578	14 906	74 624	1 224
Индекс голубых фишек	15	470 186	134 819	31 346	74 624	4 771
Индекс акций средней и малой капитализации	29 (27)	46 624	2 648	1 608	4 268	165
Индекс широкого рынка	100 (92)	613 915	208 391	6 139	74 624	13
Индекс МосБиржи инновации	8 (7)	5 156	32	645	4 203	3

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 28.02.2020г.)



В индексах МосБиржи и РТС наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансов – 46,6% и 19,3% соответственно. Так же выделяется металлургия (16,9%) и потребительский сектор (9,1%).

В Индексе голубых фишек на долю сектора энергоресурсов (нефти и газа) приходится 53,8%. Значительный вес занимают финансовый сектор (17,0%), металлургия (15,3%), а также потребительский сектор – 10,7%.

В базе расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленными секторами являются электроэнергетика и потребительский сектор – 20,0%. Телекоммуникационные компании, а также компании секторов металлургия и энергоресурсы занимают в индексе равные доли в размере 9,0%. Далее следует сектор транспорта с долей 7,7%. К группе «прочие» были отнесены холдинги, а также компании, представляющие секторы промышленность и недвижимость. Их суммарная доля составляет 20,8% в индексе. Методикой не предусмотрено включение в состав индекса ценных бумаг финансового сектора.

В Индексе акций широкого рынка наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансов – 46,5% и 18,9% соответственно. Также выделяется сектор металлов и добычи (16,6%).

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

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Индекс МосБиржи и Индекс РТС

Наибольший вес в основных индексах Московской Биржи – 14,68% занимают обыкновенные акции ПАО "Газпром". На второй позиции акции ПАО "Сбербанк" с весом 13,77%, далее – ПАО "ЛУКОЙЛ". Четвертую и пятую позиции занимают соответственно ПАО "ГМК "Норильский никель" и ПАО "НОВАТЭК".

Крупнейшие компании в индексах МосБиржи и РТС

№	Код	Наименование	Вес (на 28.02.2020)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	14,68%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,77%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	13,29%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	7,45%
5	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	4,59%
6	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	4,59%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,18%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	3,80%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	2,98%
10	MTSS	ПАО "МТС", ао	2,56%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 20 марта 2020г., Вы можете ознакомиться на сайте Биржи.

Индекс голубых фишек

Веса акций в индексе по состоянию на 28.02.2020г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 28.02.2020)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	18,13%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	17,02%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	16,42%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	9,21%
5	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	5,67%
6	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	5,67%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	5,17%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	4,69%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	3,69%
10	MTSS	ПАО "МТС", ао	3,17%
11	PLZL	ПАО "Полюс", ао	2,61%
12	FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В.и, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	2,53%
13	MGNT	ПАО "Магнит", ао	2,51%
14	ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	1,96%
15	NLMK	ПАО "НЛМК", ао	1,56%

С базой расчета Индекса голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 20 марта 2020г., 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 марта 2020г., Вы можете ознакомиться на соответствующей странице, состав Индекса акций средней и малой капитализации также представлен на сайте.

Индекс МосБиржи инноваций

Веса акций в индексе по состоянию на 28.02.2020г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 28.02.2020)
1	UNAC	ПАО "ОАК", ао	30,00%
2	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	30,00%
3	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	9,93%
4	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	9,12%
5	GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	7,94%
6	DZRDP	ОАО "Донской завод радиодеталей", ап	5,34%
7	NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	4,99%
8	DZRD	ОАО "Донской завод радиодеталей", ао	2,68%

С базой расчета Индекса МосБиржи инноваций и ее параметрами, вступающими в силу с 20 марта 2020г., 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