

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Московская биржа по рекомендации Индексного комитета сформировала базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 19 июня 2020 года, а также установила значения коэффициентов free-float для ценных бумаг ряда эмитентов.

База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС останется без изменений. В лист ожидания на включение в основные индексы войдут обыкновенные акции ПАО "Россети" и депозитарные расписки QIWI PLC.

База расчета Индекса акций широкого рынка изменится за счет исключения из состава обыкновенных акций ПАО "Русолово" и ПАО "КТК" и включения обыкновенных акций ПАО "Казаньоргсинтез" и ПАО "Белуга Групп".

В базу расчета Индекса голубых фишек, а также Индекса МосБиржи 15 войдут обыкновенные акции Полиметалл Плс, покинут индекс обыкновенные акции ПАО "НЛМК".

Базу расчета Индекса средней и малой капитализации дополняют обыкновенные акции ПАО "Селигдар" и ПАО "ВСМПО-АВИСМА", а также депозитарные расписки Эталон Групп Плс.

База расчета Индекса потребительского сектора изменится за счет включения в состав индекса обыкновенных акций ПАО "Белуга Групп". Базу расчета Индекса химии и нефтехимии дополняют обыкновенные акции ПАО "Казаньоргсинтез". Обыкновенные акции ПАО НК "РуссНефть" войдут в базу расчета Индекса нефти и газа.

На основании рекомендации Индексного комитета Биржа приняла решение отнести ПАО "ТМК" к сектору Металлы и добыча и включить обыкновенные акции эмитента в базу расчета соответствующего отраслевого индекса.

В базу расчета Индекса МосБиржи 10 войдут обыкновенные акции ПАО "Татнефть", ПАО "Московская Биржа" и ПАО "Аэрофлот", им уступят место обыкновенные акции ПАО "Магнит", ПАО "Алроса" и ПАО "РусГидро".

База расчета Индекса Инноваций останется без изменений.

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 широкого рынка	ПАО "Казаньоргсинтез", ао ПАО "Белуга Групп", ао	ПАО "Русолово", ао ПАО "КТК", ао
Индекс голубых фишек	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	ПАО "НЛМК", ао
Индекс малой и средней капитализации	ETALON GROUP PLC, ДР иностранного эмитента ПАО "Селигдар", ао ПАО "Корпорация ВСМПО-АВИСМА", ао	
Индекс нефти и газа	ПАО "НК "РуссНефть", ао	
Индекс металлов и добычи	ПАО "ТМК", ао	
Индекса потребительского сектора	ПАО "Белуга Групп", ао	
Индекс химии и нефтехимии	ПАО "Казаньоргсинтез", ао	
Индекс МосБиржи 10	ПАО "Татнефть", ао ПАО "Московская Биржа", ао ПАО "Аэрофлот", ао	ПАО "Магнит", ао ПАО "Алроса", ао ПАО "РусГидро"

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



**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	--	10%	7%
BELU	ПАО "Белуга Групп", ао	--	19 400 000	18%	--
KBTK	ПАО "КТК", ао	99 258 355	--	6%	0%
KZOS	ПАО "Казаньоргсинтез", ао	--	1 785 114 000	20%	23%
MTLR	ПАО "Мечел", ао	416 270 745	--	47%	50%
NKHP	ПАО "НКХП", ао	67 597 000	--	16%	14%
PLZL	ПАО "Полюс", ао	133 561 119	134 261 084	21%	--
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	470 230 200	471 791 037	45%	--
QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	48 879 556	51 487 257	53%	57%
RASP	ПАО "Распадская", ао	703 191 442	703 271 727	12%	--
ROLO	ПАО "Русолово", ао	3 000 100 000	--	5%	2%
RSTIP	ПАО "Российские сети", ап	2 075 149 384	--	56%	53%
RTKM	ПАО "Ростелеком", ао	2 574 914 954	--	32%	29%
TGKD	ПАО "Квадра", ао	1 912 495 577 759	--	17%	14%
TRNFP	ПАО "Транснефть", ап	1 554 875	--	32%	37%
YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	293 527 656	--	96%	97%

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 93% акций.
2. KBTK. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится 100% акций.
3. KZOS. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 77% акций.
4. MTLR. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 50% акций.
5. NKHP. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 86% акций.
6. ROLO. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 98% акций.
7. RSTIP. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 47% акций.
8. RTKM. На основании информации, опубликованной на официальном сайте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 71% акций.
9. TGKD. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, а также в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 86% акций.
10. QIWI. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 43% акций.
11. YNDX. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 3% акций.

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

С 19 июня 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	CNTL	ПАО "Центральный телеграф", ао	Индекс широкого рынка
2	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	
3	KOGK	ПАО "Коршуновский горно-обогатительный комбинат", ао	
4	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	
5	PMSB	ПАО "Пермская энергосбытовая компания", ао	
6	PMSBP	ПАО "Пермская энергосбытовая компания", ап	
7	TGKN	ПАО "ТГК-14", ао	
8	WTSM	ПАО "Центр международной торговли", ао	
9	WTCMP	ПАО "Центр международной торговли", ап	
10	YKEN	ПАО "Якутскэнерго", ао	
11	RSTI	ПАО "Россети", ао	Индекс МосБиржи, Индекс РТС
12	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	

Листы ожидания на исключение из индексов Московской Биржи

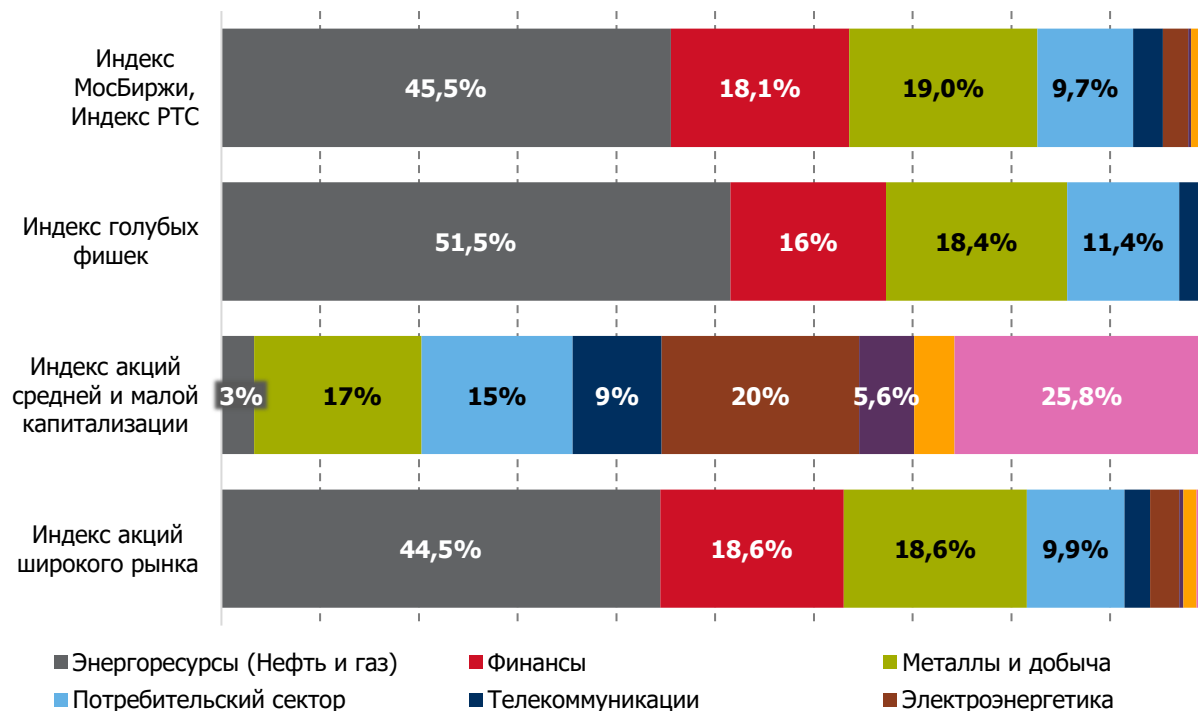
Код	Наименование	Индекс
LSNGP	ПАО "Ленэнерго", ап	Индекс широкого рынка

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 29.05.2020г.)

Индекс	Число бумаг (эмитентов)	Суммарная капитализация, млрд. руб.	Суммарная капитализация, учитываемая в индексе, млрд. руб.	Капитализация акций, входящих в новый состав индекса, млрд. руб.		
				Средняя	Макс.	Мин.
Индекс МосБиржи, Индекс РТС	38 (35)	37 689	11 640	992	4 734	60
Индекс голубых фишек	15	31 020	9 606	2 068	4 734	381
Индекс акций средней и малой капитализации	32 (30)	3 356	426	105	329	11
Индекс широкого рынка	100 (91)	41 001	14 290	410	4 734	0,952
Индекс МосБиржи инновации	8 (7)	292	2,732	37	233	0,182

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 29.05.2020г.)



В индексах МосБиржи и РТС наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и металлургия – 45,5% и 19,0% соответственно. Так же выделяются финансы (18,1%) и потребительский сектор (9,7%).

В Индексе голубых фишек на долю сектора энергоресурсов (нефти и газа) приходится 51,5%. Значительный вес занимают финансовый сектор (16,0%), металлургия (18,4%), а также потребительский сектор – 11,4%.

В базе расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленными секторами являются электроэнергетика и сектор металлов и добычи – 20,0% и 17%. Компании потребительского сектора и телекоммуникационные компании занимают в индексе доли в размере 15,0% и 9%. Далее следует сектор транспорта с долей 5,6%. К группе «прочие» были отнесены холдинги, а также компании, представляющие секторы промышленность и недвижимость. Их суммарная доля составляет 25,8% 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) – 44,5%. Компании финансового сектора и металлов занимают равные доли в размере 18,6%. Также выделяется потребительский сектор (9,9%).

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 – 15% занимают обыкновенные акции ПАО "Газпром". На второй позиции акции ПАО "Сбербанк" с весом 13%, далее – ПАО "ЛУКОЙЛ". Четвертую и пятую позиции занимают соответственно ПАО "ГМК "Норильский никель" и Яндекс.

Крупнейшие компании в индексах МосБиржи и РТС

№	Код	Наименование	Вес (на 29.05.2020)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	15,00%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,00%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	12,50%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	8,32%
5	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	5,05%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	5,05%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	3,77%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	3,19%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	3,04%
10	PLZL	ПАО "Полюс", ао	2,83%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 19 июня 2020г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).

Индекс голубых фишек

Весы акций в индексе по состоянию на 29.05.2020г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 29.05.2020)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	18,18%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	15,75%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	15,15%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	10,08%
5	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	6,12%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	6,12%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,57%
8	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	3,86%
9	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	3,68%
10	PLZL	ПАО "Полюс", ао	3,43%
11	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	3,12%
12	MTSS	ПАО "МТС", ао	3,00%
13	MGNT	ПАО "Магнит", ао	2,82%
14	FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В.и, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	2,42%
15	ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	1,72%

С базой расчета Индекса голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 19 июня 2020г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Индексы акций широкого рынка и средней и малой капитализации

С полным составом базы расчета Индекса акций широкого рынка, вступающей в силу с 19 июня 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 29.05.2020г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 29.05.2020)
1	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	30,00%
2	UNAC	ПАО "ОАК", ао	30,00%
3	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	15,54%
4	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	9,80%
5	GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	5,00%
6	NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	3,94%
7	DZRDP	ОАО "Донской завод радиодеталей", ап	3,80%
8	DZRDP	ОАО "Донской завод радиодеталей", ао	1,92%

С базой расчета Индекса МосБиржи инноваций и ее параметрами, вступающими в силу с 19 июня 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