

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Московская Биржа по рекомендации Индексного комитета сформировала базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 19 марта 2021 года, а также установила значения коэффициентов free-float для ценных бумаг ряда эмитентов.

Обыкновенные акции ПАО «Юнипро» исключаются из базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС. Лист ожидания на включение в основные индексы будет представлен обыкновенными акциями ПАО «Совкомфлот», а лист ожидания на исключение – депозитарными расписками КИВИ ПиЭлСи.

Привилегированные акции ПАО «Селигдар» наряду с обыкновенными акциями ПАО «Таттелеком» включаются в базу расчета Индекса акций широкого рынка, который покинут обыкновенные акции ПАО «ТМК» и ПАО «ДЭК».

Состав Индекса голубых фишек и базы расчета отраслевых индексов останутся без изменений.

Индекс средней и малой капитализации покинут обыкновенные акции ПАО «ТМК».

В базу расчета Индекса МосБиржи 10 войдут обыкновенные акции ПАО АФК "Система", ПАО "ММК" и ПАО "НК "Роснефть", им уступят место обыкновенные акции ПАО "Аэрофлот", ПАО "Полюс" и привилегированные акции ПАО Сбербанк.

База расчета Индекса МосБиржи инноваций останется без изменений.

Обновлены корзины индексов активов пенсионных накоплений, а также параметры баз расчета индексов МосБиржи – РСПП.

Сводная таблица изменений в списках индексов Московской Биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи и РТС		Юнипро, ао
Индекс широкого рынка	Селигдар, ап Таттелеком, ао	ДЭК, ао ТМК, ао
Индекс малой и средней капитализации		ТМК, ао
Индекс МосБиржи 10	АФК "Система", ао ММК, ао НК "Роснефть", ао	Аэрофлот, ао Полюс, ао Сбербанк, ап

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 26 февраля 2021г. 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
АРТК	ПАО "Аптечная сеть 36,6", ао	6 708 243 398	7 630 433 826	6%	--
СНМФ	ПАО "Северсталь", ао	837 718 660	837 718 660	20%	22%
ДСКУ	ПАО "Детский мир", ао	739 000 000	739 000 000	99%	74%
HYDR	ПАО "РусГидро", ао	426 288 813 551	439 288 905 849	19%	--
MGNT	ПАО "Магнит", ао	101 911 355	101 911 355	71%	68%
МТЛР	ПАО "Мечел", ао	416 270 745	416 270 745	50%	43%
НЛМК	ПАО "НЛМК", ао	5 993 227 240	5 993 227 240	19%	21%
OZON	Озон Холдингс ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	179 230 154	179 230 154	18%	21%
PLZL	ПАО "Полюс", ао	134 261 084	136 069 400	21%	--
POGR	Петропавловск ПиЭлСи, акции иностранного эмитента	3 955 788 773	3 957 270 254	65%	--
RUAL	МК ПАО "Объединенная компания "РУСАЛ", ао	15 193 014 862	15 193 014 862	16%	17%
SELGP	ПАО "Селигдар", ап	--	150 000 000	--	18%
SVET	ПАО "Светофор Групп", ао	--	22 333 500	--	3%
TCSG	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	119 291 268	199 305 492	89%	58%
TRMK	ПАО "ТМК", ао	1 033 135 366	1 033 135 366	5%	4%

Обстоятельства, учтенные при определении коэффициентов free-float:

1. СНМФ. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 78% акций.
2. ДСКУ. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 26% акций.
3. MGNT. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 32% акций.
4. МТЛР. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 57% акций.
5. НЛМК. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 79% акций.
6. OZON. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента и существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 79% акций.
7. RUAL. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 83% акций.
8. SELGP. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 82% акций.
9. SVET. На основании информации, опубликованной на официальном сайте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 97% акций.
10. TCSG. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 42% акций.
11. TRMK. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 96% акций.



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

С 19 марта 2021г. 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	FLOT	ПАО "Совкомфлот", ао	Индекс МосБиржи и РТС
2	TGKN	ПАО "ТГК-14", ао	
3	KAZT	ПАО "КуйбышевАзот", ао	Индекс широкого рынка
4	RKKE	ПАО "РКК Энергия", ао	
5	UNKL	ПАО "Южно-Уральский никелевый комбинат", ао	
6	VJGZP	ПАО "Варьеганнефтегаз", ап	
7	CNTLP	ПАО "Центральный телеграф", ап	
8	KOGK	ПАО "Коршуновский ГОК", ао	
9	BRZL	ПАО "Бурятзолото", ао	
10	ISKJ	ПАО "Институт Стволовых Клеток Человека", ао	

Листы ожидания на исключение из индексов Московской Биржи

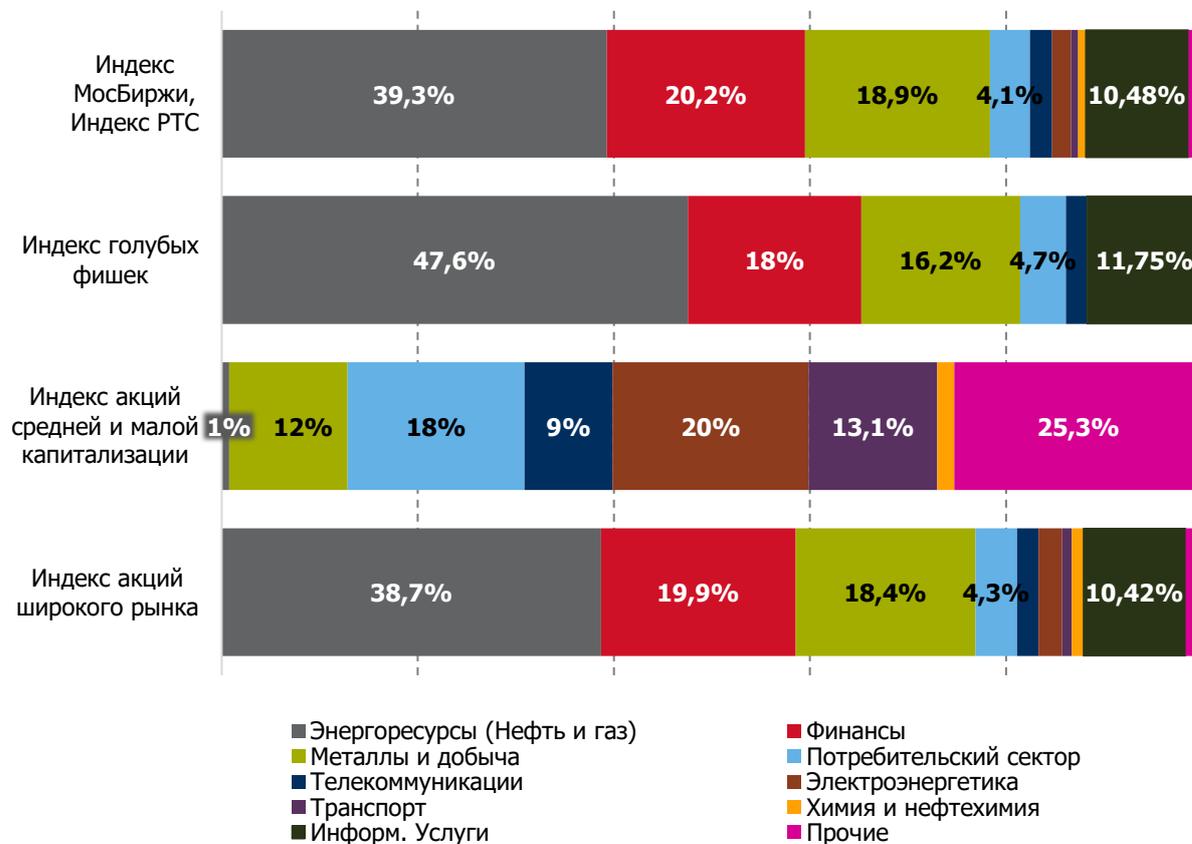
№	Код	Наименование	Индекс
1	QIWI	QIWI PLC (КИВИ ПиЭлСи), ДР иностранного эмитента на акции	Индекс МосБиржи и РТС
2	IRGZ	ПАО "Иркутскэнерго", ао	Индекс широкого рынка

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 26.02.2021г.)

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	44 (41)	48 546	16 989	1 103	5 829	42
Индекс голубых фишек	15	36 720	13 238	2 448	5 829	420
Индекс акций средней и малой капитализации	34 (32)	4 830	836	142	513	11
Индекс широкого рынка	100 (90)	52 140	18 654	521	5 829	1,410
Индекс МосБиржи инновации	7	403	10	58	221	0,953

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 26.02.2021г.)



В индексах МосБиржи и РТС наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансы – 39,3% и 20,2% соответственно. Так же выделяются металлы и добыча (18,9%) и сектор информационных услуг (10,48%).

В Индексе голубых фишек на долю сектора энергоресурсов (нефти и газа) приходится 47,6%. Значительный вес занимают сектор финансов (18%), металлов и добычи (16,2%), а также сектор информационных услуг – 11,75%.

В базе расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленными секторами являются электроэнергетика и потребительский сектор с долями – 20,0% и 18,0%. Компании транспортного сектора и металлов и добычи занимают в индексе доли в размере 13,1% и 12%. Далее следует сектор телекоммуникаций с долей 9,0%. К группе «прочие» были отнесены холдинги, а также компании, представляющие секторы промышленность и недвижимость. Их суммарная доля составляет 25,3% 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) – 38,7%. Компании финансового сектора и металлов занимают доли в размере 19,9% и 18,4%. Также выделяется сектор информационных услуг (10,42%).

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 – 13,77% занимают обыкновенные акции ПАО "Сбербанк". На второй позиции акции ПАО "Газпром" с весом 13,59%, далее – ПАО "ЛУКОЙЛ". Четвертую и пятую позиции занимают соответственно Яндекс и ПАО "ГМК "Норильский никель".

Крупнейшие компании в индексах МосБиржи и РТС

№	Код	Наименование	Вес (на 26.02.2021)
1	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,77%
2	GAZP	ПАО "Газпром", ао	13,59%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	11,20%
4	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	7,85%
5	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	7,36%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	4,80%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	3,61%
8	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	2,93%
9	TCSG	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	2,63%
10	PLZL	ПАО "Полюс", ао	2,36%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 19 марта 2021г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).

Индекс голубых фишек

Весы акций в индексе по состоянию на 26.02.2021г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 26.02.2021)
1	SBER	ПАО Сбербанк, ао	17,67%
2	GAZP	ПАО "Газпром", ао	17,44%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	14,37%
4	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	10,07%
5	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	9,45%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	6,16%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,63%
8	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	3,76%
9	PLZL	ПАО "Полюс", ао	3,03%
10	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	2,76%
11	MGNT	ПАО "Магнит", ао	2,58%
12	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	2,19%
13	MTSS	ПАО "МТС", ао	2,14%
14	FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В.и, ДР иностранного эмитента на акции	2,07%
15	MAIL	Мэйл.ру Груп Лимитед, ДР иностранного эмитента	1,68%

С базой расчета Индекса голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 19 марта 2021г., 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 марта 2021г., 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 26.02.2021г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 26.02.2021)
1	QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции	30,00%
2	UNAC	ПАО "ОАК", ао	30,00%
3	HHRU	ХэдХантер Групп ПИЭЛСИ, ДР иностранного эмитента на акции	30,00%
4	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	5,06%
5	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	2,38%
6	GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	1,36%
7	NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	1,19%

С базой расчета Индекса МосБиржи инноваций и ее параметрами, вступающими в силу с 19 марта 2021г., Вы можете ознакомиться на [соответствующей странице](#).