

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Московская Биржа по рекомендации Индексного комитета сформировала базы расчета индексов акций, которые будут действовать с 18 июня 2021 года, а также установила значения коэффициентов free-float для ценных бумаг ряда эмитентов.

В базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включаются депозитарные расписки Фикс Прайс Груп Лтд, исключаются депозитарные расписки КИВИ ПиЭлСи. Лист ожидания на исключение из основных индексов будет представлен обыкновенными акциями ПАО «Россети».

Депозитарные расписки Фикс Прайс Груп Лтд и АО О'КЕЙ ГРУПП наряду с обыкновенными акциями ПАО Группа Компаний «Сегежа» включаются в базу расчета Индекса акций широкого рынка, который покинут обыкновенные акции ПАО «Иркутскэнерго», ПАО «МОСТОТРЕСТ» и ПАО «МРСК Урала».

База расчета Индекса голубых фишек изменится за счет включения в состав обыкновенных акций ПАО «НЛМК» и исключения депозитарных расписок Мэйл.ру Груп Лимитед.

В состав базы расчета Индекса средней и малой капитализации будут добавлены обыкновенные акции ПАО Группа Компаний «Сегежа» и ПАО «Белуга Групп». Покинут индекс обыкновенные акции ПАО Группа Компаний ПИК.

На основании рекомендации Индексного комитета Биржа приняла решение о включении депозитарных расписок Фикс Прайс Груп Лтд и АО О'КЕЙ ГРУПП в состав Индекса потребительского сектора и об исключении из индекса обыкновенных акций ПАО ОР. Из состава Индекса электроэнергетики будут исключены обыкновенные акции ПАО «Иркутскэнерго» и ПАО «МРСК Урала».

В базу расчета Индекса МосБиржи 10 войдут обыкновенные акции ПАО Банк ВТБ, им уступят место обыкновенные акции ПАО АФК "Система".

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	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Груп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции	QIWI PLC (КИВИ ПиЭлСи), ДР иностранного эмитента на акции
Индекс широкого рынка	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Груп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции ПАО ГК "Сегежа", ао	ПАО "Иркутскэнерго", ао ПАО "МОСТОТРЕСТ", ао ПАО "МРСК Урала", ао
Индекс голубых фишек	ПАО "НЛМК", ао	Mail.ru Group Limited (Мэйл.ру Груп Лимитед), ДР иностранного эмитента на акции
Индекс малой и средней капитализации	ПАО ГК "Сегежа", ао ПАО "Белуга Групп", ао	ПАО ГК ПИК, ао
Индекс потребительского сектора	Fix Price Group Ltd (Фикс Прайс Груп Лтд), ДР иностранного эмитента на акции АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции	
Индекс электроэнергетики		ПАО "Иркутскэнерго", ао ОАО "МРСК Урала", ао
Индекс МосБиржи 10	ПАО Банк ВТБ, ао	АФК "Система", 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 31 мая 2021г. 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
AMEZ	ПАО "Ашинский метзавод", ао	498 454 822	498 454 822	20%	15%
ENRU	ПАО "Энел Россия", ао	35 371 898 370	35 371 898 370	31%	38%
FIXP	Фикс Прайс Груп Лтд, ДР иностранного эмитента на акции	-	850 000 000	-	21%
HYDR	ПАО "РусГидро", ао	439 288 905 849	439 288 905 849	19%	25%
LNZL	ПАО "Лензолото", ао	1 140 300	1 140 300	7%	5%
MAGN	ПАО "ММК", ао	11 174 330 000	11 174 330 000	16%	19%
MGNT	ПАО "Магнит", ао	101 911 355	101 911 355	68%	63%
MSTT	ПАО "МОСТОТРЕСТ", ао	282 215 500	282 215 500	6%	3%
MTSS	ПАО "МТС", ао	1 998 381 575	1 998 381 575	45%	42%
MVID	ПАО "М.видео", ао	179 768 227	179 768 227	10%	24%
NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	11 789 500	11 789 500	4%	12%
OKEY	АО О'КЕЙ ГРУПП, ДР иностранного эмитента на акции	-	269 074 000	-	26%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	471 818 000	473 556 152	71%	-
SELG	ПАО "Селигдар", ао	842 354 730	842 354 730	25%	28%
SELGP	ПАО "Селигдар", ап	150 000 000	150 000 000	18%	25%
SGZH	ПАО Группа Компаний "Сегежа", ао	-	15 690 000 000	-	24%
SMLT	ПАО "Группа Компаний "Самолет", ао	60 000 400	61 579 358	5%	10%
SVET	ПАО «Светофор Групп», ао	22 333 500	22 333 500	3%	10%
UNAC	ПАО "Объединенная авиастроительная корпорация", ао	492 526 129 452	520 795 137 209	3%	-
VTBR	ПАО Банк ВТБ, ао	12 960 541 337 338	12 960 541 337 338	27%	36%
YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	320 430 479	321 430 479	97%	-

Обстоятельства, учтенные при определении коэффициентов free-float:

1. AMEZ. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 85% акций.
2. ENRU. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 62% акций.
3. FIXP. На основании информации, раскрытой в проспекте эмиссии, во владении стратегических инвесторов находится не менее 79% акций.
4. HYDR. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 75% акций.
5. LNZL. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 95% акций.
6. MAGN. На основании информации, опубликованной на официальном сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 81% акций.



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

7. MGNT. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 37% акций.
8. MSTT. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 97% акций.
9. MTSS. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 58% акций.
10. MVID. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 76% акций.
11. NAUK. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, а также в существенном факте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 88% акций.
12. OKEY. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 74% акций.
13. SELG. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 72% акций.
14. SELGP. На основании информации, предоставленной эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 75% акций.
15. SGZH. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 76% акций.
16. SMLT. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
17. SVET. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.
18. VTBR. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и информационном сайте, во владении стратегических инвесторов находится не менее 64% акций.

С 18 июня 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	WTCMP	ПАО "Центр международной торговли", ап	Индекс широкого рынка
2	KAZT	ПАО "КуйбышевАзот", ао	
3	MRKY	ПАО "МРСК Юга", ао	
4	UNKL	ПАО "Южно-Уральский никелевый комбинат", ао	
5	VJGZP	ПАО "Варьеганнефтегаз", ап	
6	CHMK	ПАО "Челябинский металлургический комбинат", ао	
7	CNTLP	ПАО "Центральный телеграф", ап	
8	MGNZ	ОАО "Соликамский магниевый завод", ао	
9	NFAZ	НЕФАЗ, ао	

Листы ожидания на исключение из индексов Московской Биржи

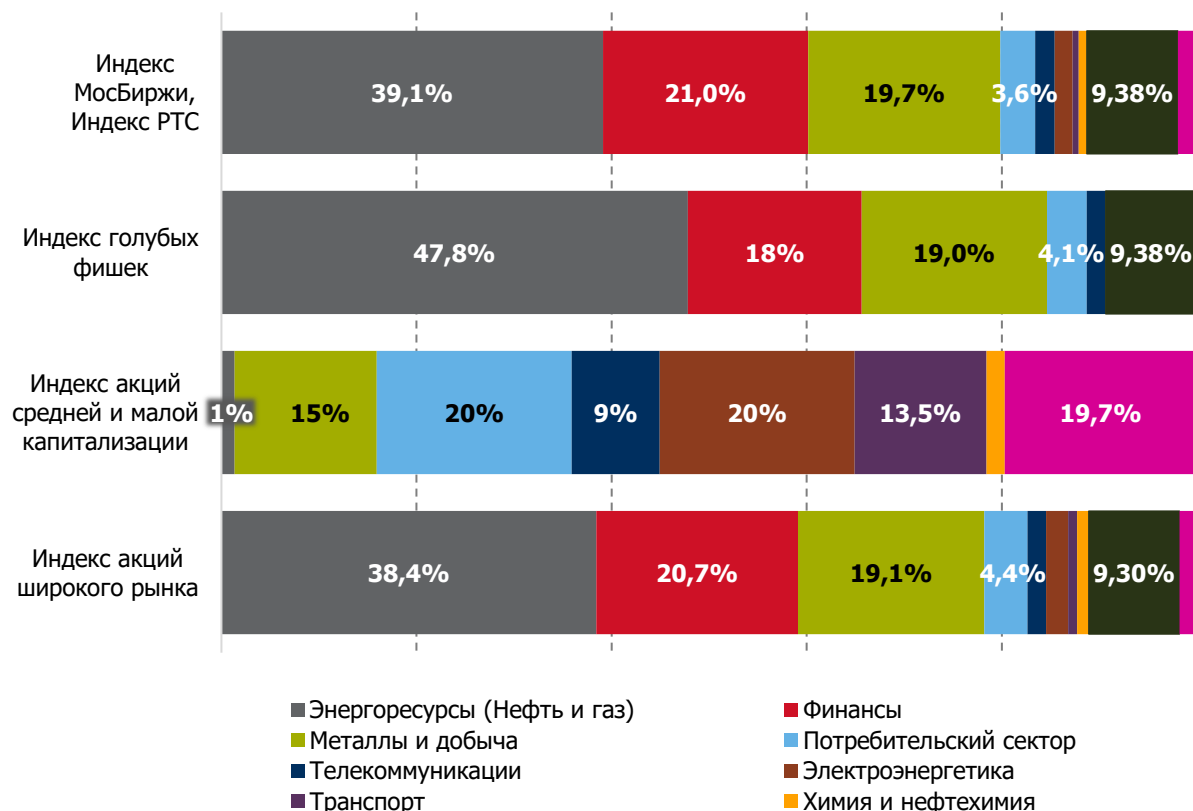
№	Код	Наименование	Индекс
1	RSTI	ПАО "Россети", ао	Индекс МосБиржи и РТС

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 31.05.2021г.)

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)	54 320	18 860	1 235	6 690	70
Индекс голубых фишек	15	41 543	14 573	2 770	6 690	556
Индекс акций средней и малой капитализации	35 (33)	4 540	784	130	375	16
Индекс широкого рынка	100 (90)	58 308	20 880	583	6 690	1,579
Индекс МосБиржи инновации	7	496	12	71	295	1,084

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 31.05.2021г.)



В индексах МосБиржи и РТС наибольший вес занимают секторы энергоресурсов (нефти и газа) и финансы – 39,1% и 21% соответственно. Так же выделяются металлы и добыча (19,7%), и сектор информационных услуг (9,38%).

В Индексе голубых фишек на долю сектора энергоресурсов (нефти и газа) приходится 47,8%. Значительный вес занимают сектор металлов и добычи (19%), финансов (18%), а также сектор информационных услуг – 9,38%.

В базе расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленными секторами являются электроэнергетика и потребительский сектор с равными долями в 20,0%. Компании металлов и добычи и транспортного сектора занимают в индексе доли в



Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

размере 15% и 13,5%. 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 19,7% 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) – 38,4%. Компании финансового сектора и металлов занимают доли в размере 20,7% и 19,1%. Также выделяется сектор информационных услуг (9,3%).

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 – 14,52% занимают обыкновенные акции ПАО "Газпром". На второй позиции акции ПАО "Сбербанк" с весом 13,75%, 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 31.05.2021)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	14,52%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,75%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	10,76%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	7,46%
5	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	7,25%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	4,86%
7	TCSG	ТиСиЭс Груп Холдинг ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент депозитарных расписок - JPMorgan Chase Bank)	3,36%
8	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	3,25%
9	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	3,08%
10	PLZL	ПАО "Полюс", ао	2,38%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 18 июня 2021г., Вы можете ознакомиться [на сайте Биржи](#).

Индекс голубых фишек

Весы акций в индексе по состоянию на 31.05.2021г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 31.05.2021)
1	GAZP	ПАО "Газпром", ао	18,80%
2	SBER	ПАО Сбербанк, ао	17,80%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	13,94%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	9,66%
5	YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	9,38%
6	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	6,29%
7	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,21%
8	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	3,99%
9	PLZL	ПАО "Полюс", ао	3,09%

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

№	Код	Наименование	Вес
10	MGNT	ПАО "Магнит", ао	2,39%
11	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	2,37%
12	NLMK	ПАО "НЛМК", ао	2,24%
13	SNGS	ПАО "Сургутнефтегаз", ао	2,21%
14	MTSS	ПАО "МТС", ао	1,93%
15	FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В., ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	1,69%

С базой расчета Индекса голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 18 июня 2021г., 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 18 июня 2021г., 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 31.05.2021г.:

№	Код	Наименование	Вес (на 31.05.2021)
1	UNAC	ПАО "ОАК", ао	30,00%
2	QIWI	QIWI ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	30,00%
3	HHRU	ХэдХантер Групп ПИЭЛСИ, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР - ДжиПиМорган Чейз Банк, Эн.Эй)	30,00%
4	ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	4,54%
5	NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	2,41%
6	LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	1,68%
7	GEMA	ПАО "ММЦБ", ао	1,38%

С базой расчета Индекса МосБиржи инноваций и ее параметрами, вступающими в силу с 18 июня 2021г., Вы можете ознакомиться на [соответствующей странице](#).