МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Утверждены базы расчета индексов Московской биржи, а также коэффициенты free-float, которые будут действовать с 16 марта 2018 года.

В базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включаются депозитарные расписки Икс 5 Ритейл Груп Н.В. с ожидаемым весом 1,13%. Данные ценные бумаги были включены в состав индекса без предварительного нахождения в листе ожидания, поскольку были впервые предложены к публичному обращению на российском фондовом рынке. Таким образом с 16 марта 2018г. в новую базу расчета войдут 46 ценных бумаг. Переход к переменному числу акций в базе расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС был сделан в декабре 2017г.

В новый лист ожидания на включение в Индекс МосБиржи и Индекс РТС войдут депозитарные расписки En+ Group plc, ликвидность которых в течение трех предшествующих месяцев существенно возросла. В новый состав листа ожидания на исключение из базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС войдут обыкновенные акции ПАО "НМТП" в связи с ухудшением показателя ликвидности, а также обыкновенные акции ПАО "Россети" и депозитарные расписки РОС АГРО ПЛС, вес которых в индексной корзине стал ниже минимально допустимого уровня – 0,2%.

База расчета индекса голубых фишек останется без изменений.

В индекс акций широкого рынка включаются депозитарные расписки Икс 5 Ритейл Груп Н.В., обыкновенные акции ПАО "ГАЗ", ПАО " Обувь России", ПАО ГК "ТНС энерго". Покинут индекс обыкновенные акции ПАО "ДИКСИ Групп" и ПАО "Уралкалий", которые исключаются из состава индекса в связи с ожидаемым делистингом, а также обыкновенные акции ПАО "ТрансКонтейнер", коэффициент free-float которых снизился ниже минимально допустимого уровня 5%, и ПАО "Комбинат Южуралникель", которые исключаются из базы расчета из-за снижения ликвидности.

В базу расчета индекса акций средней и малой капитализации войдут обыкновенные акции ПАО "Группа ЛСР", покинут индекс обыкновенные акции ПАО "СОЛЛЕРС", в связи со снижением показателя ликвидности и ПАО "ДИКСИ Групп".

В состав индекса потребительского сектора войдут депозитарные расписки Икс 5 Ритейл Груп Н.В. и обыкновенные акции ПАО " Обувь России", в то время как покинут индекс обыкновенные акции ПАО "ДИКСИ Групп".

Из корзины индекса электроэнергетики будут исключены обыкновенные акции ПАО "Квадра" в связи со снижением веса в отраслевом индексе ниже минимально установленного уровня 0,5%. Обыкновенные акции ПАО "Уралкалий" покинут индекс химии и нефтехимии, а ПАО "ТрансКонтейнер" – отраслевой индекс транспорта.

Из состава Индекса ММВБ – инновации будут исключены обыкновенные акции ОАО "Левенгук".

Сводная таблица изменений в списках индексов Московской Биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи (Индекс ММВБ), Индекс РТС	Икс 5 Ритейл Груп Н.В., ДР ин. эмитента	
Индекс акций широкого рынка	Икс 5 Ритейл Груп Н.В., ДР ин. эмитента ПАО "ГАЗ", ао ПАО " Обувь России", ао ПАО ГК "ТНС энерго", ао	ПАО "ДИКСИ Групп", ао ПАО "ТрансКонтейнер", ао ПАО "Комбинат Южуралникель", ао ПАО "Уралкалий", ао
Индекс акций средней и малой капитализации	ПАО "Группа ЛСР", ао	ПАО "ДИКСИ Групп", ао ПАО "СОЛЛЕРС", ао

МОСКОВСКАЯ БИРЖА

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс потребительского сектора	Икс 5 Ритейл Груп Н.В.и, ДР ин. эмитента ПАО " Обувь России", ао	ПАО "ДИКСИ Групп", ао
Индекс химии и нефтехимии		ПАО "Уралкалий", ао
Индекс электроэнергетики		ПАО "Квадра", ао
Индекс транспорта		ПАО "ТрансКонтейнер", ао
Индекс ММВБ - инновации		ОАО "Левенгук", 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 2018г. для следующих ценных бумаг произойдет изменение этих параметров:

Код	Наименование	Действующее количество акций	Новое количество акций	Действу-ющий free-float	Новый free-float
ACKO	ПАО "СК ЮЖУРАЛ-АСКО", ао	526 000 000		-	12%
AQUA	ПАО "Русская Аквакультура", ао	87 876 649		5%	10%
CBOM	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК", ао	27 079 709 866		23%	22%
CHMF	ПАО "Северсталь", ао	837 718 660		18%	20%
CNTLP	ПАО "Центральный телеграф", ап	55 389 000		100%	82%
DIXY	ПАО "ДИКСИ Групп", ао	124 750 000		31%	16%
DVEC	ПАО "ДЭК", ао	17 223 107 804		10%	8%
ENPL	En+ Group plc, ДР иностранного эмитента	571 428 572		11%	13%
FIVE	Икс 5 Ритейл Груп Н.В., ДР иностранного эмитента	-	271 572 872	-	41%
GAZA	ПАО "ГАЗ", ао	-	18 520 260	12%	
LVHK	ОАО "Левенгук", ао	52 940 000		6%	1%
MGNT	ПАО "Магнит", ао	94 561 355	101 911 355	69%	66%
MRKV	ПАО "МРСК Волги", ао	190 091 458 815	188 307 958 732	21%	
MRKY	ПАО "МРСК Юга", ао	61 178 139 417		39%	35%
NKHP	ПАО "НКХП", ао	67 597 000		27%	16%
OBUV	ПАО " Обувь России", ао	-	113 056 000	39%	
OPIN	ПАО "ИНГРАД", ао	41 220 793		6%	2%
OTCP	ПАО "Отисифарм", ао	145 422 732		11%	1%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции ин. эмитента	430 112 661	430 115 480	37%	
QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента	45 080 461		78%	52%
SVAV	ПАО "СОЛЛЕРС", ао	34 270 159		34%	32%
TGKD	ПАО "Квадра", ао	1 912 505 577 759		24%	17%
TNSE	ПАО ГК "ТНС энерго", ао	-	13 668 239	10%	6%
TRCN	ПАО "ТрансКонтейнер", ао	13 894 778		8%	0%
YNDX	Яндекс Н.В., акции иностранного эмитента	285 203 019	289 364 467	95%	

Обстоятельства, учтенные при определении коэффициентов free-float:

1. ACKO. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 88% акций.
2. AQUA. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 90% акций.

3. CBOM. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 78% акций.
4. CHMF. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 80% акций.
5. CNTLP. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 18% акций.
6. DIXY. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и существенных фактах эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 84% акций.
7. DVEC. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 92% акций.
8. ENPL. На основании информации, опубликованной в проспекте эмиссии эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 87% акций.
9. FIVE. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 59% акций.
10. LVHK. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц и существенных фактах эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 99% акций.
11. MGNT. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц и пресс-релизе эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 34% акций.
12. MRKY. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 65% акций.
13. NKHP. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 84% акций.
14. OPIN. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете, во владении стратегических инвесторов находится не менее 98% акций.
15. OTCP. На основании информации, опубликованной в существенных фактах эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 99% акций.
16. QIWI. На основании информации, опубликованной в ленте раскрытия информации эмитентом, во владении стратегических инвесторов находится не менее 48% акций.
17. SVAV. На основании информации, опубликованной в списке аффилированных лиц, во владении стратегических инвесторов находится не менее 68% акций.
18. TGKD. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и существенных фактах эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 83% акций.
19. TNSE. На основании информации, опубликованной в ежеквартальном отчете и на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 94% акций.
20. TRCN. На основании информации, опубликованной на сайте эмитента, во владении стратегических инвесторов находится не менее 100% акций.

С 16 марта 2018г. 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	ENPL	En+ Group plc, ДР ин. эмитента	Индекс МосБиржи и Индекс РТС
2	ACKO	ПАО "СК ЮЖУРАЛ-АСКО", ао	Индекс широкого рынка
3	AQUA	ПАО "Русская Аквакультура", ао	
4	CNTLP	ПАО "Центральный телеграф", ап	
5	DVEC	ПАО "ДЭК", ао	
6	EELT	ПАО "Европейская Электротехника", ао	
7	KOGK	ПАО "Коршуновский ГОК", ао	
8	KZOSP	ПАО "Казаньоргсинтез", ап	
9	NKNC	ПАО "Нижнекамскнефтехим", ао	
10	PRFN	ПАО "ЧЗПСН-Профнастил", ао	
11	ROLO	ПАО "Русолово", ао	

Комментарии к новым базам расчета индексов Московской Биржи

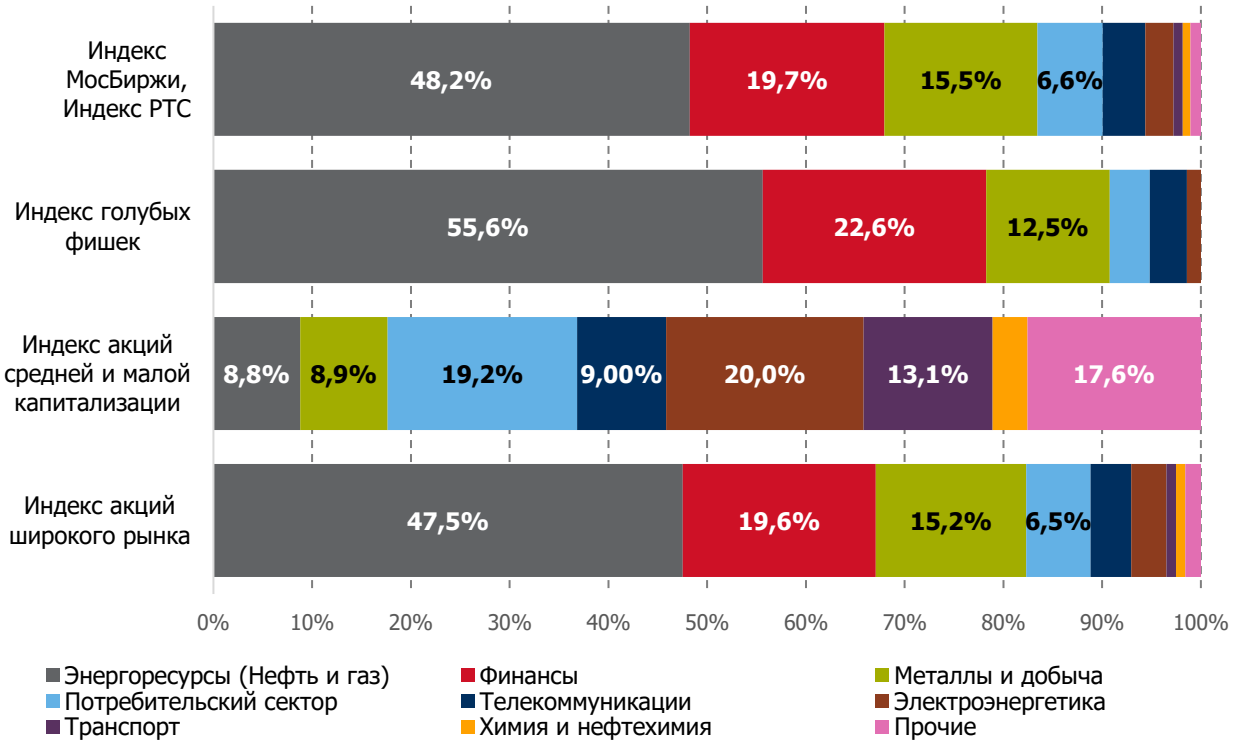
Листы ожидания на исключение в индексы Московской Биржи

№	Код	Наименование	Индекс
1	NMTP	ПАО "НМТП", ао	
2	RSTI	ПАО "Россети", ао	Индекс МосБиржи и Индекс РТС
3	AGRO	РОС АГРО ПЛС, ДР иностранного эмитента	
4	FTRE	ПАО "ФГ БУДУЩЕЕ", ао	Индекс широкого рынка

Основные характеристики композитных и тематических индексов (по ценам на 28.02.2018г.)

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 ММВБ), Индекс РТС	46 (42)	607 380	175 776	13 203	104 482	1 055,7
Индекс голубых фишек	15 (15)	463 033	140 370	30 868	104 482	4 524,1
Индекс акций средней и малой капитализации	29 (27)	52 298	10 370	1 803,4	3 983,9	223,8
Индекс широкого рынка	99 (83)	647 296	189 984	6 538	104 482	20,5
Индекс ММВБ - инновации	11 (9)	5 640,9	28,7	512,8	4 6881	1,4

Отраслевая структура композитных индексов (по состоянию на 28.02.2018г.)



В Индексе МосБиржи и Индексе РТС наибольший вес занимают сектор энергоресурсов (нефти и газа) и финансовый сектор – 48,24% и 19,72% соответственно. Так же выделяется сектор металлов и добычи (15,49%) и потребительский сектор (6,6%).

В Индексе ММВБ голубых фишек на долю сектора энергоресурсов приходится 55,62%. Значительный вес занимают финансовый сектор (22,63%), сектор металлов и добычи (12,52%), а также потребительский сектор – 6,61%.

После пересмотра базы расчета индекса акций средней и малой капитализации, наиболее широко представленными секторами являются электроэнергетика и потребительский сектор – 20,00% и 19,18% соответственно. Также существенный вес в индексе занимают сектор транспорта (13,87%) и группа «прочие» (17,57%). К группе «прочие» были отнесены холдинги, а также компании, представляющие секторы промышленность и недвижимость. Методикой не предусмотрено включение в состав индекса ценных бумаг финансового сектора.

В Индексе акций широкого рынка по-прежнему наибольший вес занимает сектор энергоресурсов (нефти и газа) и финансовый сектор – 47,54% и 19,55% соответственно. Также выделяется сектор металлов и добычи (15,24%).

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 и привилегированные акции ПАО Сбербанк. На второй позиции акции ПАО "Газпром", далее – ПАО "ЛУКОЙЛ". Четвертую и пятую позиции занимают соответственно ПАО "ГМК "Норильский никель" и ПАО "НОВАТЭК".

Крупнейшие компании в Основных индексах Московской Биржи

№	Код	Наименование	Вес (на 28.02.2018)
1	SBER	ПАО Сбербанк, ао	13,88%
	SBERP	ПАО Сбербанк, ап	1,12%
2	GAZP	ПАО "Газпром", ао	14,54%
3	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	13,78%
4	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	6,26%
5	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	5,43%
6	TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	4,19%
7	TATNP	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ап	0,60%
	SNGS	ОАО "Сургутнефтегаз", ао	2,59%
8	SNGSP	ОАО "Сургутнефтегаз", ап	1,68%
	ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	3,90%
9	MGNT	ПАО "Магнит", ао	3,25%
10	MTSS	ПАО "МТС", ао	2,98%

С полным составом базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 16 марта 2018г., Вы можете ознакомиться на соответствующей странице.

Индекс ММВБ голубых фишек

Веса акций в индексе по состоянию на 28.02.2018г.:

Код акции	Наименование	Вес в Индексе голубых фишек
GAZP	ПАО "Газпром", ао	18,20%
SBER	ПАО Сбербанк, ао	17,39%
LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	17,25%
GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	7,84%
NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	6,80%
TATN	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ао	5,24%
ROSN	ПАО "НК "Роснефть", ао	4,88%
MGNT	ПАО "Магнит", ао	4,07%
MTSS	ПАО "МТС", ао	3,74%
VTBR	Банк ВТБ (ПАО), ао	3,38%
SNGS	ОАО "Сургутнефтегаз", ао	3,25%
ALRS	АК "АЛРОСА" (ПАО), ао	2,74%
CHMF	ПАО "Северсталь", ао	1,95%
MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	1,87%
IRAO	ПАО "Интер РАО", ао	1,43%

С базой расчета Индекса ММВБ голубых фишек и ее параметрами, вступающими в силу с 16 марта 2018г., Вы можете ознакомиться на соответствующей странице.

Индексы акций широкого рынка и средней и малой капитализации

С полным составом базы расчета Индекса акций широкого рынка, вступающей в силу с 16 марта 2018г., Вы можете ознакомиться на соответствующей странице, состав Индекса акций средней и малой капитализации также представлен на сайте.

Индекс ММВБ – инновации

Веса акций в индексе по состоянию на 28.02.2018г.:

Код акции	Наименование	Вес в Индексе, %
QIWI	КИВИ ПиЭлСи, ДР иностранного эмитента на акции (эмитент ДР — The Bank of New York Mellon Corporation)	15,00%
UNAC	ПАО "ОАК", ао	15,00%
NAUK	ПАО НПО "Наука", ао	15,00%
LIFE	ПАО "Фармсинтез", ао	15,00%
DZRD	ОАО "Донской завод радиодеталей", ао	4,23%
DZRDP	ОАО "Донской завод радиодеталей", ап	9,89%
DIOD	ПАО "ДИОД", ао	9,81%
ISKJ	ПАО "ИСКЧ", ао	8,95%
RLMN	ПАО "ГК "Роллман", ао	0,86%
RLMNP	ПАО "ГК "Роллман", ап	4,82%
NSVZ	ПАО "Наука-Связь", ао	1,44%

С базой расчета Индекса ММВБ - инновации и ее параметрами, вступающими в силу с 16 марта 2018г., 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