



МОСКОВСКАЯ
БИРЖА

АВГУСТ
2019

ДАЙДЖЕСТ
ПОЛЬЗОВАТЕЛЬСКИХ
КОМИТЕТОВ
ГРУППЫ

«МОСКОВСКАЯ
БИРЖА»

Содержание

1. Изменения баз расчета индексов Московской биржи ¹	3
2. Ценовая конвенция для расчета доходности по ипотечным ценным бумагам ²	4
3. Публикация информации о премаркетинге/открытых книгах заявок по корпоративным и субфедеральным облигациям ²	4
4. Текущий статус проекта по запуску Dark Pool для облигаций Минфина ²	4

¹ Индексный комитет Московской биржи от 28.08.2019

² Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом Московской биржи от 20.08.2019

1 | Изменения баз расчета индексов Московской биржи

Участники заседания индексного комитета приняли следующие решения:

1. Рекомендовать включить в базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, вступающей в силу с 20 сентября 2019 года, обыкновенные акции ПАО «Группа ЛСР».

Сводная таблица рекомендованных Комитетом изменений в списках индексов Московской биржи

Индекс	Включены	Исключены
Индекс МосБиржи, Индекс РТС	ПАО «Группа ЛСР», ао	
Индекс голубых фишек	ПАО «НЛМК», ао	ПАО Банк ВТБ, ао
Индекс широкого рынка	ПАО «Русская Аквакультура», ао	ПАО «Ашинский метзавод», ао
	ПАО «Нижнекамскнефтехим», ао	ПАО «ГАЗ», ап
Индекс потребительского сектора	ПАО «Русская Аквакультура», ао	
Индекс акций средней и малой капитализации	ПАО «МРСК Центра», ао	ПАО НК «Русснефть», ао
		ПАО НПК «ОВК», ао
Индекс химии и нефтехимии	ПАО «Нижнекамскнефтехим», ао	
Индекс электроэнергетики		ПАО «ДЭК», ао
Индекс МосБиржи 10	ПАО «Сургутнефтегаз», ап	ПАО «Магнит», ао
Индекс инноваций	ПАО «ММЦБ», ао	

2. Рекомендовать утвердить следующие значения коэффициентов free-float:

Код	Наименование	Free-float
BLNG	ПАО «Белон», ао	3%
DVEC	ПАО «Дальневосточная энергетическая компания», ао	6%
FESH	ПАО «Дальневосточное морское пароходство», ао	26%
GEMA	ПАО «ММЦБ», ао	15%
IRGZ	ПАО «Иркутскэнерго», ао	7%
KRKNP	ПАО «Саратовский НПЗ», ап	35%
KZOS	Казанское ПАО «Органический синтез», ао	20%
LKOH	ПАО «ЛУКОЙЛ», ао	54%
LNTA	Лента Лтд., ДР иностранного эмитента	21%
MRKK	ПАО «МРСК Северного Кавказа», ао	1%
MVID	ПАО «М.видео», ао	17%
POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции ин. эмитента	45%
RKKE	ПАО «РКК «Энергия», ао	12%
RNFT	ПАО НК «РуссНефть», ао	9%
ROST	ПАО «Росинтер Ресторантс Холдинг», ао	9%
SFIN	ПАО «САФМАР Финансовые инвестиции», ао	37%
VRSB	ПАО «ТНС энерго Воронеж», ао	7%

3. Рекомендовать утвердить Методику расчета индексов акций Московской биржи в новой редакции.
4. Рекомендовать разработать предложения по включению в базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС компаний со значением коэффициента free-float от 5 до 10% при условии их веса в указанных индексах не менее 0,5% и проработать вопрос об установлении возможности для индексного комитета рассматривать данные случаи в индивидуальном порядке.
5. Рекомендовать проработать совместно с департаментом листинга биржи и Банком России вопрос о включении в первый уровень котировального списка ценных

бумаг компаний со значением коэффициента free-float не менее 5%.

6. Рекомендовать осуществлять учет в индексах корпоративных событий эмитентов после их наступления, не дожидаясь официальной регистрации эмитентом итогов в корпоративных документах.

2 | **Ценовая конвенция для расчета доходности по ипотечным ценным бумагам**

Комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом одобрил ценовую конвенцию для ипотечных ценных бумаг и рекомендовал ее использование для расчета доходности по ипотечным ценным бумагам.

Конвенция вводит определения фиксированных ценовых характеристик ипотечных ценных бумаг (ИЦБ) на основе соглашения участников рынка о вычислении денежных потоков по портфелям ипотек с последующей их трансформацией в денежные потоки по ИЦБ. Конвенция позволит в целях расчета доходности ИЦБ учитывать особенности этих инструментов с точки зрения мало прогнозируемой амортизации и поведения пула ипотечных закладных, что соответствует международной практике.

3 | **Публикация информации о премаркетинге/открытых книгах заявок по корпоративным и субфедеральным облигациям**

В настоящее время существует проблема недостаточности агрегированной информации о премаркетинге/открытых книгах заявок по облигациям, а имеющаяся информация не систематизирована. При этом на биржу все чаще обращаются инвесторы и брокеры с вопросами о списке первичных размещений. На сайте биржи активно развивается «Долговой портал», который имеет широкий набор инструментов для инвестора: календарь событий по облигациям, поиск эмиссий, калькулятор цены и доходности, графики доходности/дюрации и многое другое. Количество посетителей «Долгового портала» достигло 5000 человек в месяц. В этой связи комитет по ценным бумагам с фиксированным доходом рекомендовал Московской бирже проработать вопрос о публикации информации о премаркетинге/открытых книгах заявок по корпоративным и субфедеральным облигациям.

4 | **Текущий статус проекта по запуску Dark Pool для облигаций Минфина**

5 августа 2019 года был запущен обновленный режим торгов крупными пакетами ценных бумаг для облигаций (Dark Pool для облигаций Минфина). Члены комитета по ценным бумагам с фиксированным доходом рассмотрели и приняли к сведению информацию о текущем статусе проекта по запуску Dark Pool для облигаций Минфина.