**УТВЕРЖДЕНА**

Правлением ПАО Московская Биржа

24 февраля 2025 года, Протокол №12

**Методика расчета Индексов акций Московской Биржи**

**Москва, 2025**

**ОГЛАВЛЕНИЕ**

[1. Общие положения 3](#_Toc176857239)

[1.1. Термины и определения 3](#_Toc176857240)

[1.2. Семейство Индексов 4](#_Toc176857241)

[2. Расчет Индексов 4](#_Toc176857242)

[2.1. Общий порядок расчета ценовых Индексов 4](#_Toc176857243)

[2.2. Общий порядок расчета Индексов полной доходности 5](#_Toc176857244)

[2.3. Порядок расчета Индексов полной доходности "брутто" 6](#_Toc176857245)

[2.4. Порядок расчета Индексов полной доходности "нетто" 6](#_Toc176857246)

[2.5. Определение цены Акции 7](#_Toc176857247)

[2.6. Определение количества акций и коэффициентов free-float 8](#_Toc176857248)

[2.7. Определение коэффициента ликвидности и дополнительного весового коэффициента 9](#_Toc176857249)

[2.8. Расчет весовых коэффициентов 9](#_Toc176857250)

[2.9. Расчет Делителя 10](#_Toc176857251)

[3. Формирование и пересмотр Баз расчета Индексов 10](#_Toc176857252)

[3.1. Принципы формирования Баз расчета 10](#_Toc176857253)

[3.2. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка 11](#_Toc176857254)

[3.3. Алгоритм формирования Базы расчета Основного индекса 12](#_Toc176857255)

[3.4. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса средней и малой капитализации 13](#_Toc176857256)

[3.5. Алгоритм формирования Базы расчета индексов голубых фишек 14](#_Toc176857257)

[3.6. Алгоритм формирования Баз расчета Отраслевых Индексов 15](#_Toc176857258)

[3.7. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций 15](#_Toc176857259)

[3.8. Порядок пересмотра баз расчета 15](#_Toc176857260)

[3.9. Учет корпоративных событий 16](#_Toc176857261)

[4. Регламент расчета и раскрытия информации об Индексах 18](#_Toc176857262)

[4.1. Индексный комитет 18](#_Toc176857263)

[4.2. Расписание расчета 18](#_Toc176857264)

[4.3. Контроль за расчетом Индексов 18](#_Toc176857265)

[4.4. Раскрытие информации 19](#_Toc176857266)

[Приложение 1 20](#_Toc176857267)

[Приложение 2 22](#_Toc176857268)

[Приложение 3 23](#_Toc176857269)

[Приложение 4 25](#_Toc176857270)

[Приложение 5 26](#_Toc176857271)

[Приложение 6 27](#_Toc176857272)

# Общие положения

* 1. Термины и определения
		1. В целях настоящей Методики расчета Индексов Московской Биржи в Публичном акционерном обществе «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:
			+ - Акции – акции российских Эмитентов, допущенные к обращению на Бирже, а также акции и депозитарные расписки на акции иностранных Эмитентов, осуществляющих экономическую деятельность преимущественно на территории Российской Федерации. В Акции не входят акции, выпущенные акционерными инвестиционными фондами.
				- База расчета - список ценных бумаг для расчета Индекса.
				- Биржа, ПАО Московская Биржа - Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС»
				- День формирования Базы расчета – день, по состоянию на который рассчитываются статистические данные для составления Базы расчета. Это 15 февраля, 15 мая, 15 августа и 15 ноября. Если 15 февраля, 15 мая, 15 августа, 15 ноября не являются торговыми днями, то Днем формирования Базы расчета является торговый день, предшествующий 15 числу соответствующего месяца.
				- Индекс – показатель, рассчитываемый Биржей на основании сделок с ценными бумагами, совершенных на торгах Биржи, и отражающий изменение суммарной стоимости определённой группы ценных бумаг. Суммарная стоимость ценных бумаг может быть выражена в российских рублях, в долларах США или другой валюте. Для идентификации валюты, в которой выражается суммарная стоимость ценных бумаг соответствующего Индекса, используются следующие наименования – «Индекс в рублях», «Индекс в долларах США» и т.д.
				- Индекс полной доходности – Индекс, отражающий не только изменение суммарной стоимости ценных бумаг, включенных в Базу расчета, но и результат реинвестирования дивидендов, выплаченных по ценным бумагам, включенным в Базу расчета.
				- Индексный комитет – действующий на постоянной основе совещательный орган Биржи.
				- Коэффициент free-float – поправочный коэффициент, учитывающий количество (долю) акций или представляемых акций в свободном обращении.
				- Лист ожидания на включение (исключение) - Акции, соответствующие (не соответствующие) формальным критериям включения ценных бумаг в Базу расчета в соответствии с Методикой, претендующие на добавление (исключение) в Базу (из Базы) расчета.
				- Медианный объем торгов – медиана дневного объема торгов в рублях, рассчитанная за три месяца, предшествующие Дню формирования Базы расчета. Объем торгов определяется по режимам, установленным в соответствии с п. 2.5.1 и п. 2.5.2.
				- Отрасль – вид экономической деятельности Эмитента, который определяется на основе рекомендаций Индексного комитета. Виды отраслевой деятельности Эмитентов, Акции которых могут быть включены в Базы расчета отраслевых Индексов, приведены в Приложение 4.
				- Средняя капитализация – средняя дневная капитализация, рассчитанная за три месяца предшествующие Дню формирования Базы расчета. Дневная капитализация определяется на конец торгового дня, как произведение общего количества акций (Q), определяемого в соответствии с п.2.6.1, и цены Акции (P), определяемой в соответствии с пп.2.5.1-2.5.2.
				- Удельный вес Акции - доля стоимости Акции в суммарной стоимости всех Акций в Базе расчета, выраженная в процентах.
				- Эмитент - эмитент обыкновенных, привилегированных или представляемых акций.
		2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Биржи, а также законами и иными нормативными актами Банка России.
	2. Семейство Индексов
		1. Индексы Московской Биржи – композитные Индексы российского фондового рынка, рассчитываемые Биржей на основе цен сделок, совершаемых с наиболее ликвидными и капитализированными ценными бумагами, допущенными к обращению на Бирже.
		2. Перечень ценовых Индексов, рассчитываемых Биржей в соответствии с Методикой, приведен в Приложении 1 к Методике. Перечень товарных знаков на Индексы приведен в Приложении 5 к Методике. Перечень Индексов полной доходности, рассчитываемых Биржей в соответствии с Методикой, приведен в Приложении 6 к Методике.
		3. «Индекс МосБиржи» является фондовым Индексом, изменение значения которого используется в целях приостановки торгов ценными бумагами на Бирже в случаях, предусмотренных нормативными актами Банка России (Основной индекс).
		4. Методика, а также изменения и дополнения к ней разрабатываются с учетом рекомендаций Индексного комитета.
		5. Методика утверждается Биржей и вступает в силу в дату, определяемую Биржей. Внесение изменений и дополнений в Методику может осуществляться не чаще одного раза в квартал. Актуализация подходов, предлагаемых в Методике, должна осуществляться не реже одного раза в год.
		6. Текст утвержденной Методики раскрывается Биржей не позднее, чем за две недели до даты вступления ее в силу.

# Расчет Индексов

* 1. Общий порядок расчета ценовых Индексов
		1. Значение Индексов рассчитывается как отношение суммарной стоимости (капитализации) всех Акций по состоянию на момент расчета Индекса к значению Делителя, по следующей формуле:

$$I\_{n}=\frac{MC\_{n}}{D\_{n}} ,$$

где:

In – значение Индекса на n-ый момент расчета;

MCn – суммарная стоимость (капитализация) всех Акций по состоянию на n-ый момент расчета, определяемая в соответствии с п. 2.1.3 Методики;

Dn – значение Делителя на n-ый момент расчета Индекса;

Делитель представляет собой значение суммарной стоимости (капитализации) всех Акций на первый день расчета Индекса, скорректированное с учетом произошедших изменений Базы расчета и начального значения Индекса. В первый день расчета Индекса Делитель рассчитывается по формуле:

$$D\_{1}=\frac{MC\_{1}}{I\_{1}} ,$$

где:

MC1 – суммарная стоимость (капитализация) всех Акций на дату первого произведенного расчета Индекса;

I1 – значение Индекса на дату первого произведенного расчета.

В последующие дни Делитель остается без изменений (Dn=Dn-1), кроме случаев, описанных в п.2.9.

* + 1. Дата первого произведенного расчета каждого Индекса, а также значения I1, MC1, D1 на дату первого произведенного расчета, указаны в Приложении 2 к Методике.
		2. Суммарная стоимость всех Акций на n-ый момент расчета значения Индекса рассчитывается по формуле:

$$MC\_{n}=\sum\_{i=1}^{N}MC\_{i} ,$$

где:

N – общее количество Акций;

MCi – капитализация i-той Акции.

* + 1. Стоимость (капитализация) i-той Акции, рассчитывается по формуле:

$$MC\_{i}=\frac{P\_{i}∙Q\_{i}∙FF\_{i}∙W\_{i}}{K\_{n}} ,$$

где:

Pi – цена i-той Акции, выраженная в рублях;

Qi – общее количество i-тых Акций одной категории (типа) одного Эмитента;

FFi– Коэффициент free-float i-ой Акции;

Wi – коэффициент, ограничивающий долю капитализации i-ой Акции (Весовой коэффициент), равен 1, если иное не установлено в соответствии с п.2.8;

Kn – курс валюты на n-ый момент расчета, равный Индикативному курсу, рассчитываемому ПАО Московская Биржа, если решением Биржи не установлено иное. Соответствие валюты для каждого Индекса представлено в Приложении 1 к Методике. Для Индексов в рублях значение коэффициента равно 1.

* + 1. Капитализация Эмитента рассчитывается как сумма капитализаций Акций всех категорий данного Эмитента.
		2. Для информационных целей может рассчитываться цена Pci i-той акции, выраженная в валюте, по формуле:

$$P\_{ci}=\frac{MC\_{i}}{Q\_{i}∙FF\_{i}∙W\_{i}} ,$$

где:

MCi – капитализация i-той Акции, выраженная в валюте;

Qi – общее количество i-тых Акций одной категории (типа) одного Эмитента;

FFi– Коэффициент free-float i-ой Акции;

Wi – Весовой коэффициент.

* + 1. Значения капитализации MCi, рассчитывается с точностью до четырех знаков после запятой.
		2. Значения Индексов выражаются в пунктах и рассчитываются с точностью до двух знаков после запятой.
	1. Общий порядок расчета Индексов полной доходности
		1. Индексы полной доходности рассчитываются с использованием Баз расчета, значений и параметров соответствующих Индексов с учетом дивидендных выплат по Акциям, входящим в Базы расчета соответствующих Индексов.
		2. Дивиденды учитываются при расчете Индексов полной доходности в дату, на которую в соответствии законодательством определяются лица, имеющие право на получение дивидендов (далее – Дату закрытия реестра). Если Дата закрытия реестра не является торговым днем, дивиденды учитываются в день, предшествующий Дате закрытия реестра и являющийся торговым днем.
		3. Если информация о решениях Эмитента Акций в отношении выплаты дивидендов раскрыта Эмитентом после даты, когда дивиденды должны быть учтены в соответствии с п.2.2.2, то дивиденды учитываются в день получения Биржей указанной информации.
		4. Источниками данных о выплате дивидендов являются информационные агентства, уполномоченные на раскрытие информации, Эмитенты ценных бумаг.
		5. Дата первого произведенного расчета каждого Индекса полной доходности и значение в первый день его расчета указаны в Приложении 6 к Методике.
		6. В зависимости от учета налогообложения доходов на дивиденды рассчитываются следующие Индексы полной доходности:
			+ - "брутто" ("gross") – без учета налогообложения доходов, полученных в виде дивидендов;
				- "нетто" ("net") – с учетом налогообложения доходов, полученных в виде дивидендов. Индексы полной доходности нетто рассчитываются в двух вариантах:

по ставкам налогообложения доходов, применяемым к иностранным организациям;

по ставкам налогообложения доходов, применяемым к российским организациям.

Для целей расчета нетто Индексов полной доходности используются ставки, действующие на момент расчета Индексов полной доходности согласно Налоговому кодексу Российской Федерации. По состоянию на дату утверждения настоящей Методики используются ставки 15% для иностранных организаций и 13% для российских организаций.

* + 1. Значения Индексов полной доходности выражаются в пунктах и рассчитываются с точностью до двух знаков после запятой.
	1. Порядок расчета Индексов полной доходности "брутто"
		1. Величина дивидендов, учитываемых при расчете Индексов полной доходности, определяется по формуле:

$$TD\_{n}=\sum\_{i=1}^{N}\frac{Div\_{in}∙Q\_{in}∙FF\_{in}∙W\_{in}}{K\_{n}} , $$

где:

TDn – суммарные дивиденды по Акциям, входящим в Базу расчета соответствующего Индекса, учитываемые в день n;

N – число Акций в Базе расчета соответствующего Индекса;

Divin – размер дивидендов по i-той Акции в рублях;

Qin – общее количество i-тых Акций одной категории (типа) одного Эмитента, используемое в Базе расчета соответствующего Индекса в день n;

FFin – Коэффициент free-float i-ой Акции, используемый в Базе расчета соответствующего Индекса в день n;

Win – весовой коэффициент, используемый в Базе расчета соответствующего Индекса в день n;

Kn – принимает значение 1 для Индексов полной доходности в рублях, либо курс валюты на день n, равный курсу, используемому для расчета значения закрытия соответствующего Индекса для Индексов полной доходности в иных валютах.

* + 1. Дивиденды "брутто", выраженные в пунктах Индексов полной доходности:

$$ID\_{n}=\frac{TD\_{n}}{D\_{n}} ,$$

где:

Dn – значение Делителя соответствующего ценового Индекса на n-ый момент расчета.

* + 1. Доходность "брутто" в результате реинвестирования дивидендов определяется по формуле:

$$TR\_{n}=\frac{I\_{n}+ID\_{n}}{I\_{n-1}} ,$$

где:

In – значение ценового Индекса в день n;

In-1 – значение ценового Индекса в день n-1.

* + 1. Значение Индекса полной доходности "брутто" определяется по формуле:

$$ITR\_{n}=ITR\_{n-1} ∙TR\_{n} .$$

* 1. Порядок расчета Индексов полной доходности "нетто"
		1. Величина дивидендов, учитываемых при расчете Индекса полной доходности "нетто", определяется по формуле:

$$TDnet\_{n}=(1-\frac{TAX}{100})∙TD\_{n} ,$$

где:

TDnetn – "нетто" величина суммарных дивидендов, учитываемых в день n;

TDn – величина дивидендов "брутто";

TAX – ставка налога на доходы, полученные в виде дивидендов, в процентах.

* + 1. Дивиденды "нетто", выраженные в пунктах Индекса полной доходности:

$$IDnet\_{n}=\frac{TDnet\_{n}}{D\_{n}} ,$$

где:

Dn – значение Делителя соответствующего ценового Индекса на n-ый момент расчета.

* + 1. Доходность "нетто" в результате реинвестирования дивидендов определяется по формуле:

$$TRnet\_{n}=\frac{I\_{n}+IDnet\_{n}}{I\_{n-1}} ,$$

где:

In – значение ценового Индекса в день n;

In-1 – значение ценового Индекса в день n-1.

* + 1. Значение Индекса полной доходности "нетто" определяется по формуле:

$$ITRnet\_{n}=ITRnet\_{n-1} ∙TRnet\_{n} ,$$

* 1. Определение цены Акции
		1. Для определения цены i-ой Акции (Pi) используются цены сделок, совершаемых на организованных торгах Биржи в соответствии с Правилами проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов, а именно:
			+ - цены сделок, совершаемых с указанными Акциями в течение торгового периода Режима основных торгов T+;
				- цены закрытия Акций.
		2. Режимы торгов и периоды, в которых совершенные сделки используются для определения цены i-ой Акции в соответствии с п. 2.5.1 настоящей Методики, могут быть изменены решением Биржи.
		3. Цена i-ой Акции (Pi) устанавливается равной цене последней сделки, совершенной на торгах Биржи с данной Акцией (Pitdeal), кроме случаев, предусмотренных пунктами 2.5.5 - 2.5.6 настоящей Методики

$$P\_{i}=P\_{it}^{deal} ,$$

* + 1. Для устранения нерыночных колебаний цен ценных бумаг рассчитывается величина отклонения цены каждой сделки от средневзвешенной цены предыдущих 10 сделок. Если цена последней сделки (Pitdeal) отклоняется от средневзвешенной цены предыдущих 10 сделок на величину, превышающую установленное значение, то вместо цены последней сделки (Pitdeal) используется предыдущее значение цены (Pit-1), удовлетворяющее данному условию:

$$P\_{i}=P\_{it-1}, если \left|\frac{P\_{it}^{deal}}{P\_{it}^{avg}}-1\right|>F\_{i} ,$$

где:

Pit-1 – цена i-ой Акции в момент совершения предыдущей сделки t-1;

Pitdeal – цена последней сделки в момент t;

Fi – предельное значение отклонения, равное 0,02 для Акций, входящих в Базу расчета Индекса Основного индекса, и 0,05 для всех остальных Акций, если иное не установлено Биржей;

Pitavg – средневзвешенная цена 10 последних сделок, определяемая по формуле:

$$ P\_{it}^{avg}=\frac{\sum\_{f=t-10}^{t-1}P\_{if}^{deal}∙q\_{if}}{\sum\_{f=t-10}^{t-1}q\_{if}},$$

где:

Pifdeal – цена f-ой сделки;

qif – объем f-ой сделки, выраженный в штуках Акций.

В случае если в соответствующем режиме торгов с начала основной торговой сессии данного торгового дня с i-ой Акцией было совершено менее 10 сделок, цена i-ой Акции (Pi) устанавливается равной цене последней сделки, совершенной с данной Акцией (Pitdeal).

* + 1. Цена i-ой Акции (Pi) на момент окончания основной торговой сессии равна цене закрытия.
		2. В случае если к торгам на Бирже допущено два и более выпусков акций одного Эмитента и одной категории (типа), с различными государственными регистрационными номерами, для определения цены i-ой Акции учитываются сделки купли-продажи, совершенные с акциями основного выпуска, однако по решению Биржи может использоваться цена дополнительного выпуска.
		3. Цена i-ой Акции (Pi) определяется с точностью до величины шага цены, установленного для данной Акции в Правилах проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
		4. Порядок определения цены i-ой Акции (Pi), установленный пунктами 2.5.1 – 2.5.6 настоящей Методики, не применяется в случае, предусмотренном п.3.9.4 настоящей Методики.
	1. Определение количества акций и коэффициентов free-float
		1. В целях настоящей Методики общее количество акций (Qi) определяется как суммарное количество i-ых акций основного выпуска за вычетом погашенных (аннулированных) акций, если решением Биржи не установлено иное. Для депозитарных расписок на акции, общее количество i-ых представляемых акций (Qi) определяется как суммарное количество представляемых акций, разделенное на количество представляемых акций, право собственности на которые удостоверяется одной депозитарной расписки данного выпуска.
		2. Общее количество i-ых Акций (Qi) рассчитывается по итогам торгового дня, предшествующего дню раскрытия информации об изменении Базы расчета, за исключением случаев, предусмотренных п.3.9.4 настоящей Методики.
		3. Установление, пересмотр и раскрытие значений Коэффициентов free-float, а также определение количества акций (одной категории, типа) Эмитента (представляемых акций Эмитента), находящихся в свободном обращении в целях установления Коэффициентов free-float осуществляется на основании Методики расчета Коэффициента free-float, утвержденной Биржей.
	2. Определение коэффициента ликвидности и дополнительного весового коэффициента
		1. Для всех Акций рассчитывается коэффициент ликвидности LCi:

$$LC\_{i}=\frac{Median\left(V\_{i}\right)}{Average(P\_{i}∙Q\_{i})∙FF\_{i}∙LW\_{i}}∙WorkDays∙100\%,$$

где

Median(Vi) – Медианный объем торгов i-ой Акцией;

WorkDays – количество торговых дней в году, по умолчанию 247. Биржей может быть принято решение об установлении другого значения.

Average(Pi  Qi) – Средняя капитализация i-ой Акции;

FFi– Коэффициент free-float i-ой Акции;

LWi– Дополнительный весовой коэффициент i-ой Акции, рассчитываемый в соответствии с п. 2.7.2.

* + 1. Для всех Акций может применяться дополнительный весовой коэффициент LWi, который корректирует вес Акции в индексе. Данный коэффициент устанавливается с учетом рекомендаций Индексного комитета и может определяться следующим образом:
			- * Как отношение доли акций, находящихся на хранении в центральном депозитарии РФ (за исключением счетов типа «С»), от общего количества выпущенных акций, к Коэффициенту free-float.
				* Как отношение доли доступных для совершения сделок акций от общего количества выпущенных акций, к Коэффициенту free-float. Информация о доступности бумаг для совершения сделок определяется на основе доступных источников информации и утверждается Индексным комитетом.

Дополнительный весовой коэффициент Акции LWi принимает значение от 0 до 1 с точностью 0,1.

* 1. Расчет весовых коэффициентов
		1. Удельный вес i-ой Акции рассчитывается по следующей формуле:

$$Wght\_{i}=\frac{MC\_{i}}{\sum\_{i=1}^{N}MC\_{i} }∙100\%,$$

где:

Wghti – Удельный вес i-ой Акции;

MCi – Капитализация i-той Акции;

N – общее количество Акций.

* + 1. Удельный вес Акций одного Эмитента рассчитывается как сумма Удельных весов Акций всех категорий данного Эмитента.
		2. В целях уменьшения влияния Акций отдельных Эмитентов на значение Индексов используется весовой коэффициент WWi, рассчитываемый таким образом, чтобы Удельный вес Акции и/или Эмитента не превышал требуемого значения. Соответствующие значения и виды ограничений Удельного веса установлены в Приложении 3.
		3. Для соблюдения ограничений, указанных п.2.8.3, осуществляется процедура корректировки Удельных весов Эмитентов:
			- * Если Удельный вес Эмитента или сумма Удельных весов Эмитентов в Базе расчета Индекса превышает величину, установленную в Приложении 3, то соответствующий Удельный вес устанавливается равным этой величине.
				* Разница между Удельными весами до и после ограничения пропорционально распределяется между Эмитентами, Удельные веса которых не были ограничены.
				* Указанные выше действия повторяются итерационно пока остаются Эмитенты, Удельные веса которых превышают величину, установленную в Приложении 3.
		4. Весовой коэффициент i-ой Акции Wi, используемый при расчете Индексов, рассчитывается по следующей формуле:

$$W\_{i}=WW\_{i}∙LW\_{i} ,$$

где:

WWi – коэффициент, ограничивающий долю капитализации i-ой Акции в зависимости от Удельного веса i-ых Акций;

LWi – дополнительный коэффициент, ограничивающий долю капитализации i-ой Акции.

* + 1. Значение весового коэффициента Wi i-той Акции, используемое при расчете Индекса МосБиржи голубых фишек, принимается равным значению весового коэффициента Акции, установленного для Основного индекса.
		2. Весовые коэффициенты WWi и Wi, принимают значение от 0 до 1 с точностью до семи знаков после запятой по правилу математического округления. Расчет весовых коэффициентов осуществляется по итогам торгового дня, предшествующего дню раскрытия информации об изменении Базы расчета.
	1. Расчет Делителя
		1. Расчет Делителя Dn осуществляется в случае изменения Базы расчета, Коэффициентов free-float, коэффициентов Wi, ограничивающих долю капитализации i-ых Акций (весовых коэффициентов), и (или) при наступлении корпоративных событий в случаях, предусмотренных пп. 3.9 настоящей Методики.
		2. Расчет Делителя Dn осуществляется по следующей формуле:

$$D\_{n+1}=D\_{n}∙\frac{MC\_{n}^{`}}{MC\_{n}} , $$

где:

Dn+1 – новое значение Делителя D;

Dn – текущее значение Делителя D;

MCn – суммарная стоимость всех Акций до наступления обстоятельства, являющегося в соответствии с пунктом 2.9.1 настоящей Методики основанием для расчета нового значения Делителя D;

MCn' – суммарная стоимость всех Акций после наступления обстоятельства, являющегося в соответствии с пунктом 2.9.1 настоящей Методики основанием для расчета нового значения Делителя D.

* + 1. Расчет Делителя Dn осуществляется с точностью до четырех знаков после запятой по правилу математического округления.

# Формирование и пересмотр Баз расчета Индексов

* 1. Принципы формирования Баз расчета
		1. Базы расчета Индексов формируются из Базы расчета Индекса акций широкого рынка, определяемой в соответствии п.3.2 настоящей Методики, за исключением Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций.
		2. База расчета Индекса МосБиржи инноваций формируется на основе Акций, допущенных к торгам в Секторе Рынка инноваций и инвестиций, как это определено в п.3.7 настоящей Методики.
		3. Базы расчета Индексов содержат наименования Эмитентов Акций, а также указания на категорию (тип) ценных бумаг (для акций), наименования Эмитентов представляемых ценных бумаг (для депозитарных расписок).
		4. По рекомендации Индексного комитета Биржей может быть принято решение о включении в Базу расчета Индексов (исключении из Базы расчета) Акций, не включенных (включенных) в Базу расчета в соответствии с порядком, изложенным в пп. 3.2-3.7 настоящей Методики. Указанное решение принимается с учетом требований к содержанию Базы расчета, установленных настоящей Методикой и нормативными актами Банка России.
		5. Биржей может быть принято решение об исключении из Базы расчета Индексов Акций Эмитентов, публично не раскрывающих информацию о владельцах акций и/или представляемых акций Эмитента, в том числе бенефициарных владельцах, в течение 6 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета, в связи с невозможностью определения Коэффициентов free-float данных Акций в порядке, установленном в разделе 2.6 настоящей Методики и Методике расчета Коэффициента free-float, утвержденной Биржей.
	2. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка
		1. База расчета Индекса акций широкого рынка включает 100 Акций, если иное не установлено Биржей. При этом База расчета Индекса акций широкого рынка должна включать Акции не менее 10 Эмитентов.
		2. В Базу расчета Индекса акций широкого рынка включаются Акции, прошедшие процедуру листинга на Бирже.
		3. В Базу расчета Индекса акций широкого рынка могут быть включены Акции, которые были включены в текущий Лист ожидания на включение и Акции Эмитентов, ценные бумаги которых были публично размещены путем первичного предложения или вторичной публичной продажи Акций.
		4. Из Базы расчета Индекса акций широкого рынка исключаются Акции, у которых значение Коэффициента free-float составляет менее 5%, а также в случае возникновения событий, предусмотренных п. 3.8.4.
		5. Из Базы расчета Индекса акций широкого рынка могут быть исключены Акции, которые были включены в текущий Лист ожидания на исключение.
		6. В Базу расчета включаются Акции, у которых доля торговых дней, в течение каждого из которых с данными Акциями была совершена хотя бы одна сделка, от общего числа торговых дней за три месяца, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета, составляет не менее 70% и значение коэффициента LCi не менее 1%.
		7. Для целей формирования Базы расчета предварительно составляется список из 120 Акций, соответствующих пп.3.2.2, 3.2.4 и 3.2.6 с наибольшим значением Медианного объема торгов, если иные требования не установлены Биржей.
		8. База расчета Индекса акций широкого рынка формируется из Акций, входящих в текущую Базу расчета Индекса акций широкого рынка, по следующему алгоритму:
			+ - Исключаются Акции, указанные в п. 3.2.4, а также Акции, указанные в п. 3.2.5 и не входящие в список, указанный в п.3.2.7.
				- Оставшиеся Акции и Акции, указанные в п.3.2.3, и входящие в список, указанный в п.3.2.7, ранжируются по убыванию Средней капитализации с учетом актуального на Дату формирования Базы расчета Коэффициента free-float и дополнительного коэффициента LWi с присвоением условного порядкового номера.
				- Включаются Акции, имеющие порядковый номер на 5 или более позиций меньше числа Акций в текущей Базе расчета Индекса акций широкого рынка.
				- Исключаются Акции, указанные в п. 3.2.5 и имеющие порядковый номер на 5 или более позиций больше числа Акций в текущей Базе расчета Индекса акций широкого рынка.
		9. Если после формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка в соответствии с п.3.2.8 количество акций меньше предусмотренного требованиями п.3.2.1, в Базу расчета Индекса акций широкого рынка включаются Акции, входящие в Лист ожидания на включение и имеющие наибольшую Среднюю капитализацию с учетом актуального Коэффициента free-float и дополнительного коэффициента LWi.
		10. Если после формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка в соответствии с п.3.2.8 количество акций больше предусмотренного требованиями п.3.2.1, из Базы расчета Индекса акций широкого рынка исключаются Акции имеющие наименьшую Среднюю капитализацию с учетом актуального Коэффициента free-float и дополнительного коэффициента LWi. При этом сначала исключаются акции, входящие в Лист ожидания на исключение.
		11. Новый состав Листа ожидания на исключение формируется из Акций, входящих в Базу расчета Индекса акций широкого рынка и не входящих в список, указанный в п. 3.2.7.
		12. Новый состав Листа ожидания на включение формируется из Акций, не входящих в Базу расчета Индекса акций широкого рынка и входящих в список, указанный в п. 3.2.7. В Лист ожидания включается не более 10 таких Акций, ранжированных по убыванию Средней капитализации с учетом актуального Коэффициента free-float.
		13. По рекомендации Индексного комитета Биржей может быть принято решение об увеличении до 6 месяцев срока нахождения в составе Листов ожидания Акций, являющихся акциями иностранных Эмитентов или иностранными депозитарными расписками на акции.
	3. Алгоритм формирования Базы расчета Основного индекса
		1. Основным индексом является Индекс МосБиржи. Базы расчета Индекса РТС и Индекса МосБиржи – активное управление аналогичны Базе расчета Индекса МосБиржи.
		2. База расчета Основного индекса включает 50 Акций, если иное не установлено Биржей. База расчета может включать меньшее число Акций, если в ходе ее формирования окажется, что количество Акций, соответствующих предъявляемым настоящей Методикой требованиям, составляет менее 50. При этом База расчета Основного индекса должна включать Акции не менее 10 Эмитентов.
		3. База расчета Основного индекса, а также Лист ожидания на включение в соответствующие Индексы формируются из Акций, включенных в котировальные списки Биржи, если иное не установлено Биржей в случае получения соответствующих рекомендаций Индексного комитета.
		4. В новую Базу расчета Основного индекса включаются Акции, входящие в один из следующих списков:
			+ - В текущую Базу расчета Основного индекса;
				- В текущий Лист ожидания на включение;
				- Публично размещенные и впервые предложенные к публичному обращению Акции;
				- Публично размещенные путем вторичной публичной продажи Акции.
		5. В Базу расчета Основного индекса и/или в Лист ожидания на включение могут быть включены Акции, соответствующие следующим требованиям:
			+ - значение Коэффициента free-float составляет не менее 10%;
				- доля торговых дней, в течение каждого из которых с данными Акциями была совершена хотя бы одна сделка, от общего числа торговых дней за шесть месяцев, предшествующих Дню формирования Базы расчета Основного индекса, составляет не менее 99%;
				- значение коэффициента LCi составляет не менее 15%;
				- Эмитент Акций раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой не более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета Основного индекса.
		6. Из Базы расчета Основного индекса должны быть исключены или включены в Лист ожидания на исключение Акции, соответствующие одному из следующих требований:
			+ - значение Коэффициента free-float составляет менее 5%;
				- доля торговых дней, в течение каждого из которых с данными Акциями была совершена хотя бы одна сделка, от общего числа торговых дней за шесть месяцев, предшествующих Дню формирования Базы расчета Основного индекса, составляет менее 90%;
				- значение коэффициента LCi составляет менее 10%;
				- Эмитент Акций раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета;
				- Акции исключены из котировальных списков Биржи.
		7. Новая База расчета Основного индекса формируется по следующему алгоритму:
			+ - Из Базы расчета Основного индекса исключаются Акции, у которых значение Коэффициента free-float составляет менее 5% или которые были исключены из Базы расчета Индекса широкого рынка;
				- Из Базы расчета Основного индекса исключаются Акции, которые ранее были включены в Лист ожидания на исключение и показатели которых соответствуют требованиям п.3.3.6.
				- Для оставшихся Акций, входящих в Базу расчета Основного индекса, а также Акций, входящих в списки, обозначенные в п.3.3.4, показатели которых соответствуют п., рассчитываются весовые коэффициенты Wi и Удельные веса в соответствии с п.2.8 с использованием средней капитализации, рассчитанной по ценам закрытия за три месяца, предшествующих Дню формирования Базы расчета, актуального Коэффициента free-float и Дополнительного весового коэффициента LWi.
				- В Базу расчета Основного индекса включаются Акции, Удельный вес которых составляет более 0,25%, и которые были включены в Базу расчета Основного индекса или Листы ожидания на включение.
				- Из Базы расчета Основного индекса исключаются Акции, Удельный вес которых составляет менее 0,2%, и которые были включены в Лист ожидания на исключение.
				- Из Базы расчета Основного индекса исключаются Акции, Удельный вес которых составляет менее 0,1%, без учета их вхождения в Лист ожидания на исключение.
				- В случае превышения в Базе расчета Основного индекса количества Акций, предусмотренного п. величины, из Базы расчета Основного индекса исключаются Акции, имеющие наименьшую Среднюю капитализацию с учетом актуального Коэффициента free-float и дополнительного коэффициента LWi.
		8. Новый состав Листа ожидания на исключение формируется из Акций, входящих в Базу расчета Основного индекса, а также соответствующих критериям п.3.3.6 или имеющих Удельный вес менее 0,2%.
		9. В случае включения в Лист ожидания на исключение из Основного индекса Акций, имеющих Удельный вес в Основном индексе на День формирования Базы расчета не менее 2%, более двух раз подряд может применяться принцип поэтапного исключения таких Акций из Базы расчета Основного индекса. В рамках ближайшего очередного пересмотра Базы расчета Основного индекса по отношению к таким Акциям применяется значение дополнительного весового коэффициента LWi, рассчитанное в соответствии с п. 2.7.2, умноженное на 0,5. В рамках следующего очередного пересмотра Базы расчета Основного индекса, в случае соответствия Акций критериям п. 3.3.6, такие Акции исключаются из Базы расчета Основного индекса.
		10. Новый состав Листа ожидания на включение формируется из Акций, не входящих в Базу расчета Основного индекса и соответствующих критериям п. , при условии, что потенциальный Удельный вес Акций в Базе расчета Основного индекса превышает 0,2%. В Лист ожидания включается не более 10 таких Акций, ранжированных по убыванию Средней капитализации с учетом актуального Коэффициента free-float и дополнительного весового коэффициента LWi.
	4. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса средней и малой капитализации
		1. Количество Акций в Базе расчета Индексов средней и малой капитализации – переменное.
		2. База расчета Индекса средней и малой капитализации формируется из Акций, включенных в котировальные списки Биржи.
		3. В новую Базу расчета Индекса средней и малой капитализации включаются Акции, входящие в новую Базу расчета Индекса акций широкого рынка.
		4. Эмитенты, Акции которых соответствуют требованиям п.3.4.3, ранжируются по убыванию Средней капитализации с присвоением условного порядкового номера R. Для каждого такого R-ого Эмитента рассчитывается коэффициент SR:

$$S\_{R}=\frac{\sum\_{j=1}^{R}MC\_{j}}{\sum\_{j=1}^{M}MC\_{j}} ,$$

где

R – порядковый номер Эмитента;

M – общее количество Эмитентов;

MCj – средняя капитализация, рассчитанная за три месяца предшествующих Дню формирования Базы расчета, всех категорий Акций j-ого Эмитента.

* + 1. Параметру r присваивается значение порядкового номера R последнего по счету Эмитента, у которого значение коэффициента SR, рассчитанного в соответствии с п.3.4.4, составляет меньше 90%. Параметру m - значение порядкового номера R последнего по счету Эмитента, у которого значение коэффициента SR составляет меньше 85%.
		2. В Базу расчета Индекса средней и малой капитализации могут быть включены Акции, соответствующие следующим требованиям:
			- * входит в список, обозначенный в п.3.4.2 и 3.4.3;
				* Эмитент Акций раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой не более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета Индекса средней и малой капитализации;
				* значение коэффициента LCi составляет не менее 12%;
				* порядковый номер R Эмитента этих Акций, рассчитанный в соответствии с п.3.4.4, больше номера r+1, рассчитанного в соответствии с п.3.4.5
		3. Из Базы расчета Индекса средней и малой капитализации могут быть исключены Акции, соответствующие следующим требованиям:
			- * не входит в список, обозначенный в п.3.4.2 и 3.4.3;
				* Эмитент Акций раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета Индекса средней и малой капитализации;
				* значение коэффициента LCi составляет менее 7%;
				* Порядковый номер R Эмитента Акций, рассчитанный в соответствии с п.3.4.4, меньше номера m+1, рассчитанного в соответствии с п.3.4.5;
		4. Новая База расчета Индекса средней и малой капитализации формируется по следующему алгоритму:
			- * Из Базы расчета исключаются Акции, соответствующие требованиям п.3.4.7;
				* В Базу расчета включаются Акции, соответствующие требованиям п.3.4.6;
				* Для Акций в Базе расчета Индекса средней и малой капитализации, рассчитываются Удельные веса, в соответствии с п.2.8.1 с использованием средней капитализации, рассчитанной по ценам закрытия за три месяца, предшествующих Дню формирования Базы расчета, c учетом актуального Коэффициента free-float и Дополнительного весового коэффициента LWi;
				* Из Базы расчета исключаются Акции, Удельный вес которых составляет менее 0,5% и которые не были включены в текущую Базу расчета;
				* Из Базы расчета исключаются Акции, Удельный вес которых составляет менее 0,3% и которые были включены в текущую Базу расчета.
		5. В случае если в Базу расчета Индекса средней и малой капитализации включено недостаточно Эмитентов для одновременного соблюдения Ограничения 5/10/40 и Ограничения веса отрасли, то приоритет отдается Ограничению 5/10/40. При несоблюдении Ограничения 5/10/40, Биржа может принять решение о пересмотре коэффициентов, указанных в пп.3.4.2-3.4.8 для достижения нужного количества Эмитентов для расчета указанного ограничения.
	1. Алгоритм формирования Базы расчета индексов голубых фишек
		1. Базы расчета Индекса МосБиржи голубых фишек и Индекса МосБиржи 15 включает 15 Акций, если иное не установлено Биржей. В индексы голубых фишек может быть включен только один тип акций одного эмитента. Индекс МосБиржи голубых фишек и Индекс МосБиржи 15 различаются между собой требованиями к ограничению удельных весов Акций в Базах расчета этих индексов.
		2. Базы расчета индексов голубых фишек формируются из Акций, входящих в Базу расчета Основного индекса, по следующему алгоритму:
			+ - Отбираются Акции на основании субъективной (экспертной) оценки Индексного комитета, порядковый номер которых в рейтинге по Медианному объему торгов, рассчитанному за шесть месяцев, не превышает 30, если иные требования не установлены Биржей.
				- Акции ранжируются по Средней капитализации, определенной по ценам закрытия за три месяца, предшествующих Дню формирования Базы расчета, с учетом Дополнительного весового коэффициента LWi и актуального Коэффициента free-float при этом первой в списке категории Акций каждого Эмитента присваивается порядковый номер, остальным категориям Акций данного Эмитента порядковый номер не присваивается.
				- Исключаются Акции, имеющие порядковый номер 18 или больший номер и входящие в текущую Базу расчета Индекса голубых фишек, вместо которых включаются Акции с наименьшим номером, начиная с 17 по убыванию.
				- Включаются Акции, имеющие порядковый номер 13 или меньший номер и не входящие в текущую Базу расчета Индекса голубых фишек; при этом из Базы расчета Индекса голубых фишек исключаются Акции с наибольшим номером, начиная с 14 по возрастанию.
	2. Алгоритм формирования Баз расчета Отраслевых Индексов
		1. Количество Эмитентов Акций в Базе расчета отраслевого Индекса не должно быть меньше трех, если иное не установлено Биржей.
		2. В соответствии с п.3.6.1 База расчета отраслевых Индексов формируется последовательно по следующему алгоритму:
			+ - Отбираются Акции, входящие в Базу расчета Индекса акций широкого рынка, на основании субъективной (экспертной) оценки Индексного комитета.
				- Акции, по которым определена Отрасль, включаются в соответствующую этой Отрасли Базу расчета.
				- Исключаются Акции, входившие ранее в Базу расчета соответствующего отраслевого Индекса, Удельный вес которых в отраслевом Индексе, рассчитанный с использованием средней капитализации, определенной по ценам закрытия за три месяца, предшествующих Дню формирования Базы расчета, с учетом актуального Коэффициента free-float и Дополнительного весового коэффициента LWi, составляет менее 0,4%.
				- Включаются Акции, не входившие ранее в Базу расчета соответствующего отраслевого Индекса, Удельный вес которых в отраслевом Индексе, рассчитанный с использованием средней капитализации, определенной по ценам закрытия за три месяца, предшествующих Дню формирования Базы расчета, с учетом актуального Коэффициента free-float и Дополнительного весового коэффициента LWi, составляет более 0,6%.
	3. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций
		1. Количество Акций в Базе расчета Индекса МосБиржи инноваций – переменное.
		2. В Базу расчета Индекса МосБиржи инноваций включаются Акции, допущенные к торгам в Секторе Рынка инноваций и инвестиций.
		3. В Базу расчета Индекса МосБиржи инноваций могут быть включены Акции Эмитентов, ценные бумаги которых были публично размещены и впервые предложены к публичному обращению, публично размещены путем вторичной публичной продажи или впервые включены в Сектор Рынка инноваций и инвестиций.
		4. Из Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций могут быть исключены Акции в случаях возникновения событий, предусмотренных п.3.8.4.
		5. В Базу расчета включаются Акции, у которых доля торговых дней, в течение каждого из которых с данными Акциями была совершена хотя бы одна сделка, от общего числа торговых дней за три месяца, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета, составляет не менее 50%.
		6. На основании субъективной (экспертной) оценки формируется список не более чем из 30 Акций, соответствующих п. 3.7.2 и 3.7.5, с максимальным значением Медианного объема торгов, если иные требования не установлены Биржей.
		7. База расчета Индекса МосБиржи инноваций формируется из Акций, входящих в текущую Базу расчета Индекса МосБиржи инноваций по следующему алгоритму:
			+ - Исключаются Акции, не входящие в список, указанный в п.3.7.6.
				- Включаются Акции, входящие в список, указанный в п.3.7.6, а также могут быть включены Акции, указанные в п.3.7.3.
		8. На основании субъективной (экспертной) оценки Биржей может быть принято решение о включении в Базу расчета (исключении из Базы расчета) Индекса МосБиржи инноваций Акций, не включенных (включенных) в Базу расчета Индекса МосБиржи инноваций в соответствии с порядком, изложенным в пп. 3.7.1-3.7.7 настоящей Методики. Указанное решение принимается с учетом требований к содержанию Базы расчета, установленных настоящей Методикой и нормативными актами Банка России.
	4. Порядок пересмотра баз расчета
		1. Включение Акций в Базы расчета и исключение Акций из Баз расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета.
		2. Очередной пересмотр Баз расчета осуществляется не чаще одного раза в квартал, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Пересмотренные Базы расчета вступают в силу с начала основной торговой сессии торгового дня, следующего за третьим четвергом марта, июня, сентября и декабря. Решением Биржи могут быть установлены иные даты вступления в силу пересмотренных Баз расчета.
		3. Формирование Баз расчета при очередном пересмотре производится в соответствии с пп. 3.1-3.7 настоящей Методики.
		4. Внеочередной пересмотр Баз расчета может быть осуществлен в случае возникновения следующих событий:
			+ - при исключении Акций из списка ценных бумаг, допущенных к торгам на Бирже, а также из котировальных списков;
				- в связи с введением ограничения возможности совершения сделок с Акциями секции/режиме торгов, используемом для расчета Индексов в соответствии с пунктом 2.5.1 и пунктом 2.5.2 настоящей Методики;
				- в случае реорганизации или ликвидации Эмитента ценных бумаг, размещения дополнительного выпуска ценных бумаг, аннулирования (погашения) ценных бумаг, в том числе в результате их конвертации, выкупа (приобретения) ценных бумаг их Эмитентом;
				- в иных случаях, которые могут оказать существенное влияние на расчет Индекса.
		5. Информационные сообщения об очередном пересмотре Баз расчета раскрываются не позднее, чем за 2 недели до вступления в силу решения Биржи об утверждении новых Баз расчета.
		6. Информационные сообщения о внеочередном пересмотре Баз расчета раскрываются не позднее дня, предшествующего дате вступления в силу новых Баз расчета.
	5. Учет корпоративных событий
		1. В случае дробления или консолидации представляемых акций, изменения объема и/или порядка осуществления прав, закрепленных представляемыми акциями в соответствии с иностранным правом, решение об учете данных событий принимается Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета.
		2. Приостановка торгов акциями на Бирже.

В случае приостановки торгов i-ой акцией на Бирже на срок более одного торгового дня цена, учитываемая в Индексах, остается равной цене, рассчитанной в день приостановки торгов.

* + 1. Размещение дополнительных акций, погашение (аннулирование) акций Эмитентом ценных бумаг

Допуск к торгам на Бирже i-ых акций дополнительного выпуска и погашение (аннулирование) i-ых акций непосредственно не являются основанием для пересчета общего количества i-ых акций (Qi). Указанный пересчет осуществляется в установленном порядке в срок, предусмотренный пунктом 2.6.1 настоящей Методики.

* + 1. Дробление или консолидация акций

В случае дробления или консолидации i-ых акций в дату допуска к торгам выпуска акций, в которые осуществлена конвертация акций в связи с их дроблением или консолидацией, осуществляется пересчет общего количества i-ых акций (Qi), а также цены i-той акции (Pi), рассчитанной по итогам торгового дня, предшествующего указанной дате. В ходе такого пересчета общее количество i-ых акций (Qi) умножается на коэффициент дробления или делится на коэффициент консолидации, а цена i-той акции (Pi) делится на коэффициент дробления или умножается на коэффициент консолидации.

* + 1. Реорганизация акционерного общества, Акции которого включены в Базу расчета

При реорганизации акционерного общества осуществляются действия, направленные на адекватный учет при расчете Индексов факта реорганизации. В зависимости от формы реорганизации возможно осуществление разных действий. Решение о том, какое именно действие осуществляется, принимается Биржей по рекомендации Индексного комитета. Информация о принятых решениях раскрывается в соответствии с пунктом 4.4.

* + 1. Примерный порядок действий при реорганизации акционерных обществ, акции которых включены в Базу расчета:
			1. Слияние акционерных обществ

При реорганизации акционерных обществ в форме слияния акции реорганизуемых акционерных обществ исключаются из Базы расчета в срок, определенный Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета.

* + - 1. Реорганизация акционерного общества в форме разделения

При реорганизации акционерного общества в форме разделения акции реорганизуемого акционерного общества исключаются из Базы расчета в срок, определенный Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета.

* + - 1. Реорганизация акционерного общества в форме выделения

При реорганизации акционерного общества в форме выделения цена акций этого акционерного общества (i-ых акций) (Pi) фиксируется на уровне, определенном по итогам торгового дня, предшествующего дате фиксации. Дата фиксации цены i-ой акции (Pi), а также условия прекращения фиксации цены i-ой акции (Pi) определяются Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета. В дату прекращения фиксации цены i-ой акции (Pi) осуществляется пересчет общего количества i-ых акций (Qi) и Делителя D.

* + - 1. Реорганизация акционерного общества в форме присоединения

При присоединении к акционерному обществу, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества цена акций (i-ых акций) (Pi) фиксируется на уровне, определенном по итогам торгового дня, предшествующего дате фиксации. Дата фиксации цены i-ой акции (Pi), а также условия прекращения фиксации цены i-ой акции (Pi) определяются Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета. В дату прекращения фиксации цены i-ой акции (Pi) осуществляется пересчет общего количества i-ых акций (Qi) и Делителя D.

При присоединении акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, к другому акционерному обществу, акции исключаются из Базы расчета в срок, определенный Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета.

* + - 1. Реорганизация акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, в форме разделения или выделения, осуществляемого одновременно со слиянием или с присоединением.

При выделении из акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества с одновременным присоединением последнего к акционерному обществу, акции которого включены в Базу расчета, в отношении выделения применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.3 настоящей Методики, а в отношении присоединения – правила, предусмотренные абзацем вторым пунктом 3.9.6.4 настоящей Методики, за исключением требования о пересчете Делителя D.

При выделении из акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества с одновременным присоединением последнего к акционерному обществу, акции которого не включены в Базу расчета, применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.3 настоящей Методики.

При выделении из акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества с одновременным слиянием последнего с акционерным обществом, акции которого включены в Базу расчета, в отношении выделения применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.3 настоящей Методики, а в отношении слияния – правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.1 настоящей Методики.

При выделении из акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества с одновременным слиянием последнего с акционерным обществом, акции которого не включены в Базу расчета, применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.3 настоящей Методики.

При разделении акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, с одновременным присоединением вновь возникшего акционерного общества к акционерному обществу, акции которого включены в Базу расчета, в отношении разделения применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.2 настоящей Методики, а в отношении присоединения – правила, предусмотренные абзацем вторым пункта 3.9.6.4 настоящей Методики, за исключением требования о пересчете коэффициента D.

При разделении акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, с одновременным присоединением вновь возникшего акционерного общества к акционерному обществу, акции которого не включены в Базу расчета, применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.2 настоящей Методики.

При разделении акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, с одновременным слиянием вновь возникшего акционерного общества с акционерным обществом, акции которого включены в Базу расчета, в отношении разделения применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.2 настоящей Методики, а в отношении слияния – правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.1 настоящей Методики.

При разделении акционерного общества, акции которого включены в Базу расчета, другого акционерного общества с одновременным слиянием вновь возникшего акционерного общества с акционерным обществом, акции которого не включены в Базу расчета, применяются правила, предусмотренные пунктом 3.9.6.2 настоящей Методики.

# Регламент расчета и раскрытия информации об Индексах

* 1. Индексный комитет
		1. Индексный комитет осуществляет следующие функции:
			+ - формирование экспертного мнения, предложений и рекомендаций уполномоченному органу Биржи по вопросам развития системы управления Индексами и иными индикаторами, рассчитываемыми Биржей;
				- разработка предложений в части совершенствования методик расчета Индексов и иных индикаторов;
				- осуществление экспертизы ценных бумаг при пересмотре баз расчета Индексов;
				- разработка предложений по внедрению Биржей новых Индексов, технологий, расчетов и принятие по ним рекомендаций;
				- разработка рекомендаций в отношении раскрытия информации об Индексах и иных индикаторах;
				- рассмотрение претензий и предложений со стороны пользователей Индексов и в случае наличия обоснованных и существенных претензий совместно с Биржей принятие мер по разработке и реализации соответствующих изменений;
				- разработка предложений по совершенствованию эффективности системы управления Индексами и иными индикаторами, рассчитываемыми Биржей, рассмотрение соответствующих вопросов и принятие рекомендаций.
		2. Ведение деятельности по созданию, расчету, пересмотру и обновлению Индексов и настоящей Методики основано на совокупности административных принципов и правил, описанных в Политике Индекс-менеджмента Московской Биржи.
	2. Расписание расчета
		1. Расчет значений Индексов осуществляется с периодичностью, установленной в Приложении 1. Расчет Индексов полной доходности осуществляется с периодичностью, установленной в Приложении 6. Указанная периодичность расчета Индексов может быть изменена решением Биржи, но в пределах сроков, установленных нормативными актами Банка России.
		2. Расчет Индексов осуществляется в течение основной торговой сессии. Расчет отдельных Индексов, указанных в Приложении 1, также осуществляется в течение дополнительных торговых сессий (в случае их проведения). Перечень Индексов, расчет которых осуществляется в течение дополнительных торговых сессий, а также перечень дополнительных торговых сессий, в течение которых рассчитываются Индексы, может быть изменен решением Биржи, с учетом требований, установленных нормативными актами Банка России.
		3. Первые значения Индексов, публикуемые в течение основной торговой сессии, являются значениями открытия соответствующего Индекса соответствующего торгового дня.
		4. Последние значения Индексов, публикуемые в течение основной торговой сессии, являются значениями закрытия соответствующего Индекса соответствующего торгового дня.
		5. Если иное не установлено нормативными актами Банка России, Биржа вправе изменять время начала и (или) время окончания расчета Индексов. Информация о решениях, принятых Биржей в соответствии с настоящим пунктом, доводится до участников торгов Биржи не менее чем за пять рабочих дней до даты вступления в силу соответствующих изменений, если Биржей не установлен иной срок, путем раскрытия соответствующей информации.
	3. Контроль за расчетом Индексов
		1. В случае возникновения технического сбоя при расчете Индексов либо технического сбоя в ходе торгов ценными бумагами на Бирже, приведшего к искажению данных, использовавшихся для расчета Индексов, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений Индексов. Указанный перерасчет осуществляется в минимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя. При перерасчете значений Индексов соответствующее сообщение раскрывается на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
		2. В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексами реального состояния российского финансового рынка, Биржа вправе предпринять любые действия, необходимые для обеспечения адекватности Индексов, в том числе исключить Акции из Базы расчета, установить значения параметров, используемых для расчета показателей, предусмотренных настоящей Методикой и т.д.
		3. Совокупность принципов, которыми руководствуется Биржа в области разработки, расчета и распространения Индексов в случае обнаружения ошибок в значениях Индексов, закреплена в Положении о пересчете значений индексов ПАО Московская Биржа.
	4. Раскрытие информации
		1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой и нормативными актами Банка России, осуществляется на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
		2. При изменении используемых в расчете Индексов показателей, основанных на субъективной (экспертной) оценке, Биржа раскрывает на официальном сайте в сети Интернет информацию об обстоятельствах, учтенных при изменении указанных показателей, и обоснование таких изменений не позднее дня, следующего за днем их изменения.
		3. Помимо информации, раскрытие которой предусмотрено настоящей Методикой, Биржа ежедневно раскрывает:
			+ - Базу расчета,
				- Информацию об Акциях, входящих в состав Листов ожидания на включение и исключение,
				- Общее количество i-ых Акций (Qi) по каждой i-ой Акции,
				- Удельный вес i-ой Акций по каждой i-ой Акции,
				- Значения закрытия Индексов,
				- Значения курса рубля к доллару США, использованному при расчете соответствующего значения Индекса.
		4. Текущие значения Индексов раскрываются в течение 2 минут с момента их расчета.
		5. Настоящая Методика, информация о значениях закрытия Индексов, об общем количестве i-ых Акций (Qi) по каждой i-ой Акции, об Удельном весе i-ой Акций по каждой i-ой Акции доступны любому заинтересованному лицу на официальном сайте Биржи в сети Интернет за последние 2 года.
		6. Информация, подлежащая раскрытию в соответствии с настоящей Методикой, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах ценными бумагами на Бирже.

# Приложение 1

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Перечень ценовых Индексов Московской Биржи**

| **Код Индекса** | **Наименование Индекса** | **Наименование Индекса на английском языке** | **Валюта** | **Периодичность расчета** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| IMOEX, IMOEX2\* | Индекс МосБиржи | MOEX Russia Index | RUB | 1 раз в секунду в течение основной, а также утренней и вечерней дополнительных торговых сессий |
| RTSI | Индекс РТС | RTS Index | USD | 1 раз в секунду в течение основной торговой сессии |
| IMOEXCNY | Индекс МосБиржи в юанях | MOEX Russia CNY Index | CNY | 1 раз в 15 секунд в течение основной торговой сессии |
| IMOEXW | Индекс МосБиржи – активное управление | MOEX Active Management Index | RUB | 1 раз в день |
| MOEXBC | Индекс МосБиржи голубых фишек | MOEX Blue Chip Index | RUB | 1 раз в секунду в течение основной торговой сессии |
| MRBC | Индекс МосБиржи 15 | MOEX 15 Index | RUB |
| MOEXBMI | Индекс МосБиржи широкого рынка | MOEX Broad Market Index | RUB | 1 раз в 15 секунд в течение основной торговой сессии |
| RUBMI | Индекс РТС широкого рынка | RTS Broad Market Index  | USD |
| MCXSM | Индекс МосБиржи средней и малой капитализации  | MOEX SMID Index | RUB | 1 раз в день |
| RTSSM | Индекс РТС средней и малой капитализации | RTS SMID Index | USD |
| MOEXINN | Индекс МосБиржи инноваций | MOEX Innovation Index | RUB | 1 раз в 15 секунд в течение основной торговой сессии |
| MOEXOG | Индекс МосБиржи нефти и газа | MOEX Oil and Gas Index | RUB |
| RTSog | Индекс РТС нефти и газа | RTS Oil & Gas Index | USD |
| MOEXEU | Индекс МосБиржи электроэнергетики | MOEX Electric Utilities | RUB |
| RTSeu | Индекс РТС электроэнергетики | RTS Electric Utilities Index | USD |
| MOEXTL | Индекс МосБиржи телекоммуникаций | MOEX Telecommunication Index | RUB |
| RTStl | Индекс РТС телекоммуникаций  | RTS Telecom Index | USD |
| MOEXMM | Индекс МосБиржи металлов и добычи | MOEX Metals and Mining Index | RUB |
| RTSmm | Индекс РТС металлов и добычи | RTS Metals & Mining Index | USD |
| MOEXFN | Индекс МосБиржи финансов | MOEX Financials Index | RUB |
| RTSfn | Индекс РТС финансов | RTS Finances Index | USD |
| MOEXCN | Индекс МосБиржи потребительского сектора | MOEX Consumer Index | RUB |
| RTScr | Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли | RTS Consumer & Retail Index | USD |
| MOEXCH | Индекс МосБиржи химии и нефтехимии | MOEX Chemicals Index | RUB |
| RTSch | Индекс РТС химии и нефтехимии | RTS Chemicals Index | USD |
| MOEXTN | Индекс МосБиржи транспорта | MOEX Transportation Index | RUB |
| RTStn | Индекс РТС транспорта | RTS Transport Index | USD |
| MOEXRE | Индекс МосБиржи строительных компаний | MOEX Real Estate Index | RUB |
| RTSre | Индекс РТС строительных компаний | RTS Real Estate Index | USD |
| MOEXIT | Индекс МосБиржи информационных технологий | MOEX IT Index | RUB |
| RTSit | Индекс РТС информационных технологий | RTS IT Index | USD |

\* Индекс МосБиржи в течение основной торговой сессии транслируется с кодом «IMOEX». Индекс МосБиржи в течение всего торгового дня, включая дополнительные торговые сессии (в случае их проведения), транслируется с кодом «IMOEX2».

# Приложение 2

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Начальные параметры ценовых Индексов Московской Биржи**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Код Индекса** | **Начальное значение I1 (Ic1)** | **Дата первого расчета** | **Начальное значение MC1 (MCc1)** | **Начальное значение****D1 (Dc1)** |
|
| IMOEX | 100 | 22.09.1997 | 240 287 712 872,71 | р. | 2 402 877 128,73 |
| RTSI | 100 | 01.09.1995 | 12 666 080 264 | $ | 126 660 802,64 |
| IMOEXCNY | 1000 | 30.12.2022 | 1 060 822 686 440,63 | р. | 1 060 822 686,4406 |
| MOEXBMI | 1000 | 30.12.2011 | 5 714 921 368 642,70  | р. | 5 714 921 368,6427 |
| IMOEXW | 3008,39 | 20.12.2019 | 12 284 745 918 148,80  | р. | 4 083 495 131,3323 |
| RUBMI | 1000 | 30.12.2011 | 178 017 187 340,90 | $ | 178 017 187,3409 |
| MCXSM | 1000 | 17.12.2012 | 249 935 428 677 | р. | 249 935 428,6769 |
| RTSSM | 1 515,27 | 17.12.2012 | 11 584 398 749 | $ | 7 645 105,3272 |
| MOEXBC | 6 285,76 | 23.04.2009 | 1 836 578 113 861,74  | р. | 292 180 756,7998 |
| MRBC | 1000 | 29.12.2017 | 6 218 324 312 661,0600  | р. | 6 218 324 312,6611 |
| MOEXINN | 1000 | 29.12.2009 | 428 041 076,70  | р. | 428 041,0767 |
| MOEXOG | 1000 | 30.12.2004 | 53 793 633 597,22 | р. | 53 793 633,5972 |
| RTSog | 100 | 11.01.2005 | 9 590 765 088,91 | $ | 95 907 650,8891 |
| MOEXEU | 1000 | 30.12.2004 | 6 732 754 947,68 | р. | 6 732 754,9477 |
| RTSeu | 100 | 11.01.2005 | 1 441 517 330,27 | $ | 14 415 173,3027 |
| MOEXTL | 1000 | 30.12.2004 | 11 455 529 806,37 | р. | 11 455 529,8064 |
| RTStl | 100 | 11.01.2005 | 2 422 838 888,30 | $ | 24 228 388,8830 |
| MOEXMM | 1000 | 30.12.2004 | 349 854 916,02 | р. | 349 854,9160 |
| RTSmm | 100 | 11.01.2005 | 848 833 618,13 | $ | 8 488 336,1813 |
| MOEXFN | 1000 | 30.12.2004 | 74 334 296 834,00 | р. | 74 334 296,8340 |
| RTSfn | 100 | 11.01.2005 | 4 189 660 578,42 | $ | 41 896 605,7842 |
| MOEXCN | 1000 | 30.12.2004 | 9 977 568 980,59 | р. | 9 977 568,9806 |
| RTScr | 100 | 11.01.2005 | 257 127 656,10 | $ | 2 571 276,5610 |
| MOEXCH | 3500 | 29.12.2006 | 5 012 127 842,40 | р. | 1 432 036,5264 |
| RTSch | 100 | 29.12.2006 | 190 005 187,57 | $ | 1 900 051,8757 |
| MOEXTN | 2500 | 28.12.2007 | 38 893 555 834,62 | р. | 15 557 422,3338 |
| RTStn | 250 | 28.12.2007 | 1 578 555 517,73 | $ | 6 314 222,0709 |
| MOEXRE | 5000 | 20.03.2020 | 83 629 120 509,31 р. | 16 725 824,1019  |
| RTSre | 150 | 20.03.2020 | 1 052 290 709,96 $ | 7 015 271,3998 |
| MOEXIT | 5000 | 25.12.2020 | 1 951 286 456 728,32 р. | 390 257 291,3457 |
| RTSit | 150 | 25.12.2020 | 26 299 610 573,94 $ | 175 330 737,1597 |

#

# Приложение 3

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Виды ограничений Удельного веса Акций Эмитентов в Индексе**

**Ограничение веса Эмитента**

Удельный вес Акций каждого Эмитента не должен превышать установленную величину ограничения на Дату формирования Базы расчета для следующих индексов:

|  |  |
| --- | --- |
| **Код Индекса** | **Величина ограничения, %** |
| IMOEX, RTSI, IMOEXCNY, MOEXBMI, RUBMI | 15 |
| MOEXBC | 20 |
| MRBC | 9\* |
| MOEXINN | 30 |
| IMOEXW | 9\* |

\* Удельный вес Акций каждого Эмитента на День формирования Базы расчета определяется как величина ограничения доли оценочной стоимости одного юридического лица в структуре имущества паевого инвестиционного фонда, установленная законами и иными нормативными актами Банка России, уменьшенная на 1%.

Удельный вес Акций каждого Эмитента на День формирования Баз расчета Отраслевых индексов устанавливается в соответствии с указанной шкалой:

|  |  |
| --- | --- |
| **Количество Эмитентов в Базе расчета** | **Величина ограничения, %** |
| от 3 до 4 включительно | 40 |
| от 5 до 7 включительно | 30 |
| от 8 до 9 включительно | 20 |
| от 10 и более | 15 |

Удельный вес Акций каждого Эмитента на каждый момент расчета значения Индексов не должен превышать 30% для следующих Индексов:

* IMOEX
* RTSI
* IMOEXCNY

Если по итогам любого торгового дня Удельный Акций какого-либо Эмитента, входящего в Базу расчета указанных Индексов, превысит 25%, Биржа вправе принять решение о внеочередном расчете весовых коэффициентов для соблюдения данного требования.

**Ограничение веса 5 Эмитентов**

Сумма Удельных весов Акций пяти наибольших по Удельному весу Эмитентов на Дату формирования Базы расчета не должна превышать 55%, а на каждый момент расчета значения Индексов не должна превышать 60% для следующих Индексов:

* IMOEX
* RTSI
* IMOEXCNY

Если по итогам любого торгового дня сумма пяти максимальных Удельных весов Эмитентов Акций указанных Индексов превысит 59%, Биржа вправе принять решение о внеочередном расчете весовых коэффициентов для соблюдения данного требования.

**Ограничение 5/10/40**

На Дату формирования Базы расчета Индексов Удельный вес Акций одного Эмитента не должен превышать 9%, а также сумма Удельных весов Акций Эмитентов, Удельный вес каждого из которых превышает 4,5%, не должна быть выше 36%.

На каждый момент расчета Индексов Удельный вес Акций одного Эмитента не должен превышать 10%, а также сумма Удельных весов Акций Эмитентов, Удельный вес каждого из которых превышает 5%, не должна быть выше 40%.

Ограничение установлено для следующих Индексов:

* MCXSM
* RTSSM

Если по итогам торгового дня n-4, где n – дата вступления в силу новой Базы расчета Индексов, определенная в соответствии с 3.8.2 настоящей Методики, Удельный вес Акций одного Эмитента в новой Базе расчета превысит 10% и/или сумма Удельных весов Акций Эмитентов, вес каждого из которых составляет более 5%, превысит 40%, Биржа в праве произвести пересчет весовых коэффициентов в новой Базе расчета Индексов. Новые значения весовых коэффициентов рассчитываются по итогам торгового дня n-4 и раскрываются на следующий торговый день (n-3).

Если по итогам любого торгового дня Удельный вес Акций одного Эмитента превысит 10% и/или сумма Удельных весов Акций, вес каждого из которых составляет более 5%, превысит 40%, Биржа в праве произвести внеочередной расчет весовых коэффициентов для соблюдения установленного требования.

**Ограничение веса отрасли**

Сумма Удельных весов Акций Эмитентов, относящихся к одной отрасли, не должна превышать установленную величину на Дату формирования Базы расчета:

|  |  |
| --- | --- |
| **Код Индекса** | **Величина ограничения, %** |
| MCXSMRTSSM | 20 |

# Приложение 4

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Виды отраслевой деятельности Эмитентов, акции которых могут быть включены в Базы расчета отраслевых Индексов**

| **Индексы** | **Отрасль** | **Вид деятельности** |
| --- | --- | --- |
| MOEXOG, RTSog | Энергоресурсы | Интегрированные нефтяные и газовые компании  |
| Разведка и добыча нефти и газа  |
| Переработка и сбыт нефти и газа  |
| Хранение и транспортировка нефти и газа  |
| Бурение нефтяных и газовых скважин |
| Производство оборудования для нефтегазовой отрасли и услуги по его использованию  |
| Добыча угля и потребляемого топлива  |
| MOEXCH, RTSch | Химия и нефтехимия | Производство основных химических веществ |
| Диверсифицированные химические компании  |
| Производство удобрений и химической продукции сельскохозяйственного назначения |
| Производство промышленных газов  |
| Производство химических веществ специального назначения |
| MOEXMM, RTSmm | Металлы и добыча | Производство алюминия  |
| Диверсифицированные металлургические и добывающие компании, включая добычу коксующегося угля |
| Добыча меди |
| Добыча золота  |
| Добыча драгоценных металлов и минералов  |
| Добыча серебра |
| Производство стали  |
| - | Промышленность\* | Аэрокосмическая и оборонная промышленность |
| Производство строительных изделий |
| Строительство и монтаж инженерного оборудования |
| Производство электрооборудования  |
| Деятельность по управлению финансово-промышленными группами и холдинг-компаниями  |
| Машиностроение |
| Торговые компании и дистрибьюторы  |
| MOEXTN, RTStn | Транспорт | Грузовые перевозки воздушным транспортом и логистика  |
| Деятельность воздушного транспорта |
| Деятельность морского транспорта |
| Деятельность автомобильного и железнодорожного транспорта  |
| Транспортная инфраструктура  |
| MOEXCN, RTScr | Потребительский сектор | Легковые автотранспортные средства и комплектующие  |
| Потребительские товары длительного пользования и одежда |
| Потребительские услуги  |
| СМИ, рекламная и издательская деятельность |
| Розничная торговля |
| Пищевая промышленность |
| Бытовые товары и предметы личной гигиены  |
| Здравоохранение |
| MOEXFN, RTSfn | Финансы | Банковская деятельность |
| Диверсифицированные финансовые услуги  |
| Страхование |
| MOEXTL, RTStl | Телекоммуникации | Предоставление разнообразных услуг в области телекоммуникаций |
| Предоставление услуг беспроводной связи  |
| MOEXEU, RTSeu | Электроэнергетика | Электроснабжение |
| MOEXIT, RTSit | Информационные технологии | Программное обеспечение и услуги |
| Производство высокотехнологичных аппаратных средств, полупроводников и оборудования |
| MOEXRE, RTSre | Строительство | Операции с недвижимостью |
| Жилищное строительство |
| - | Холдинги\* | Компании, ведущие деятельность в нескольких секторах экономики |

\* Расчет отраслевого индекса не осуществляется

# Приложение 5

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Товарные знаки**

| **Код Индекса** | **Товарный знак** | **Номер Свидетельства на товарный знак** |
| --- | --- | --- |
| **IMOEX, IMOEXCNY, IMOEXW** | Индекс МосБиржи | 630519 |
| MOEX Russia Index | 643075 |
| **RTSI** | Индекс РТС | 322604 |
| RTS Index | 326584 |
| **MOEXBC** | Индекс МосБиржи голубых фишек | 684316 |
| **MOEXEU** | Индекс МосБиржи электроэнергетики | 684143 |
| **RTSeu** | Индекс РТС электроэнергетики | 379935 |
| RTS Electric Utilities Index | 380232 |
| **RTSfn** | Индекс РТС финансов | 380225 |
| RTS Finances Index | 380228 |
| **RTSmm** | Индекс РТС металлов и добычи | 380229 |
| RTS Metals & Mining Index | 380227 |
| **RTSog** | Индекс РТС нефти и газа | 380231 |
| RTS Oil & Gas Index | 380230 |
| **RTScr** | Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли | 384024 |
| RTS Consumer & Retail Index | 380233 |
| **RTStl** | Индекс РТС телекоммуникаций | 384023 |
| RTS Telecom Index | 384022 |
| **RTSin** | Индекс РТС промышленности | 380226 |
| RTS Industrial Index | 387179 |

# Приложение 6

**к Методике расчета Индексов Московской Биржи**

**Перечень Индексов полной доходности**

| **Код ценового Индекса** | **Индексы полной доходности** | **Валюта расчета**  |
| --- | --- | --- |
| **«брутто»** | **«нетто», по налоговым ставкам иностранных организаций** | **«нетто», по налоговым ставкам российских организаций** |
| **Код** | **Наименование** | **Код** | **Наименование** | **Код** | **Наименование** |
| IMOEX | MCFTR | MOEX Russia Total Return Index | MCFTRN | MOEX Russia Net Total Return (Non-Resident) Index | MCFTRR | MOEX Russia Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи полной доходности «брутто».Индекс МосБиржи полной доходности | Индекс МосБиржи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSI | RTSTR | RTS Total Return Index | RTSTRN | RTS Net Total Return (Non-Resident) Index | RTSTRR | RTS Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС полной доходности | Индекс РТС полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| IMOEXCNY | MCFCNYTR | MOEX Russia CNY Total Return Index | MCFCNYTRN | MOEX Russia CNY Net Total Return (Non-Resident) Index | MCFCNYTRR | MOEX Russia CNY Net Total Return (Resident) Index | CNY |
| Индекс МосБиржи в юанях полной доходности | Индекс МосБиржи в юанях полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи в юанях полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| IMOEXW | MCFWTR | MOEX Active Management Total Return Index  | MCFWTRN | MOEX Active Management Net Total Return (Non-Resident) Index | MCFWTRR | MOEX Active Management Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи – активное управление полной доходности | Индекс МосБиржи – активное управление полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи – активное управление полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| IMOEX2 | MCF2TR | MOEX Russia Total Return Index 2 | MCF2TRN | MOEX Russia Net Total Return (Non-Resident) Index 2 | MCF2TRR | MOEX Russia Net Total Return (Resident) Index 2 | RUB |
| Индекс МосБиржи полной доходности 2. | Индекс МосБиржи полной доходности 2 «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи полной доходности 2 «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXBC | MEBCTR | MOEX Blue Chip Total Return Index | MEBCTRN | MOEX Blue Chip Net Total Return (Non-Resident) Index | MEBCTRR | MOEX Blue Chip Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи голубых фишек полной доходности | Индекс МосБиржи голубых фишек полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи голубых фишек полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MRBC | MRBCTR | Индекс МосБиржи полной доходности 15 | - | - | - | - | RUB |
| MOEX 15 Total Return Index | - | - |
| MCXSM | MESMTR | MOEX SMID Total Return Index | MESMTRN | MOEX SMID Net Total Return (Non-Resident) Index | MESMTRR | MOEX SMID Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи средней и малой капитализации полной доходности | Индекс МосБиржи средней и малой капитализации полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи средней и малой капитализации полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSSM | RUSMTR | RTS SMID Total Return Index | RUSMTRN | RTS SMID Net Total Return (Non-Resident) Index | RUSMTRR | RTS SMID Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС средней и малой капитализации полной доходности | Индекс РТС средней и малой капитализации полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС средней и малой капитализации полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXOG | MEOGTR | MOEX Oil and Gas Total Return Index | MEOGTRN | MOEX Oil and Gas Net Total Return (Non-Resident) Index | MEOGTRR | MOEX Oil and Gas Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи нефти и газа полной доходности | Индекс МосБиржи нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSog | RUOGTR | RTS Oil & Gas Total Return Index | RUOGTRN | RTS Oil & Gas Net Total Return (Non-Resident) Index | RUOGTRR | RTS Oil & Gas Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС нефти и газа полной доходности | Индекс РТС нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXEU | MEEUTR | MOEX Electric Utilities Total Return Index | MEEUTRN | MOEX Electric Utilities Net Total Return (Non-Resident) Index | MEEUTRR | MOEX Electric Utilities Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи электроэнергетики полной доходности | Индекс МосБиржи электроэнергетики полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи электроэнергетики полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSeu | RUEUTR | RTS Electric Utilities Total Return Index | RUEUTRN | RTS Electric Utilities Net Total Return (Non-Resident) Index | RUEUTRR | RTS Electric Utilities Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС электроэнергетики полной доходности | Индекс РТС электроэнергетики полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС электроэнергетики полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXTL | METLTR | MOEX Telecommunication Total Return Index | METLTRN | MOEX Telecommunication Net Total Return (Non-Resident) Index | METLTRR | MOEX Telecommunication Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи телекоммуникаций полной доходности | Индекс МосБиржи телекоммуникаций полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи телекоммуникаций полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTStl | RUTLTR | RTS Telecommunication Total Return Index | RUTLTRN | RTS Telecommunication Net Total Return (Non-Resident) Index | RUTLTRR | RTS Telecommunication Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС телекоммуникаций полной доходности | Индекс РТС телекоммуникаций полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС телекоммуникаций полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXMM | MEMMTR | MOEX Metals and Mining Total Return Index | MEMMTRN | MOEX Metals and Mining Net Total Return (Non-Resident) Index | MEMMTRR | MOEX Metals and Mining Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи металлов и добычи полной доходности | Индекс МосБиржи металлов и добычи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи металлов и добычи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSmm | RUMMTR | RTS Metals & Mining Total Return Index | RUMMTRN | RTS Metals & Mining Net Total Return (Non-Resident) Index | RUMMTRR | RTS Metals & Mining Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС металлов и добычи полной доходности | Индекс РТС металлов и добычи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС металлов и добычи полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXFN | MEFNTR | MOEX Financials Total Return Index | MEFNTRN | MOEX Financials Net Total Return (Non-Resident) Index | MEFNTRR | MOEX Financials Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи финансов полной доходности | Индекс МосБиржи финансов полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи финансов полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSfn | RUFNTR | RTS Financials Total Return Index | RUFNTRN | RTS Financials Net Total Return (Non-Resident) Index | RUFNTRR | RTS Financials Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС финансов полной доходности | Индекс РТС финансов полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС финансов полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) | USD |
| MOEXCN | MECNTR | MOEX Consumer Total Return Index | MECNTRN | MOEX Consumer Net Total Return (Non-Resident) Index | MECNTRR | MOEX Consumer Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи потребительского сектора полной доходности | Индекс МосБиржи потребительского сектора полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи потребительского сектора полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTScr | RUCNTR | RTS Consumer Total Return Index | RUCNTRN | RTS Consumer Net Total Return (Non-Resident) Index | RUCNTRR | RTS Consumer Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли полной доходности | Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС потребительских товаров и розничной торговли полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXCH | MECHTR | MOEX Chemicals Total Return Index | MECHTRN | MOEX Chemicals Net Total Return (Non-Resident) Index | MECHTRR | MOEX Chemicals Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи химии и нефтехимии полной доходности | Индекс МосБиржи химии и нефтехимии полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи химии и нефтехимии полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSch | RUCHTR | RTS Chemicals Total Return Index | RUCHTRN | RTS Chemicals Net Total Return (Non-Resident) Index | RUCHTRR | RTS Chemicals Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС химии и нефтехимии полной доходности | Индекс РТС химии и нефтехимии полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС химии и нефтехимии полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXTN | METNTR | MOEX Transportation Total Return Index | METNTRN | MOEX Transportation Net Total Return (Non-Resident) Index | METNTRR | MOEX Transportation Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи транспорта полной доходности | Индекс МосБиржи транспорта полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи транспорта полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTStn | RUTNTR | RTS Transportation Total Return Index | RUTNTRN | RTS Transportation Net Total Return (Non-Resident) Index | RUTNTRR | RTS Transportation Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС транспорта полной доходности | Индекс РТС транспорта полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС транспорта полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXRE | MERETR | MOEX Real Estate Total Return Index | MERETRN | MOEX Real Estate Net Total Return (Non-Resident) Index | MERETRR | MOEX Real Estate Net Total Return (Resident) Index | RUB |
| Индекс МосБиржи строительных компаний полной доходности | Индекс МосБиржи строительных компаний полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс МосБиржи строительных компаний полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| RTSre | RURETR | RTS Real Estate Total Return Index | RURETRN | RTS Real Estate Net Total Return (Non-Resident) Index | RURETRR | RTS Real Estate Net Total Return (Resident) Index | USD |
| Индекс РТС строительных компаний полной доходности | Индекс РТС строительных компаний полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | Индекс РТС строительных компаний полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) |
| MOEXIT | MEITTR | Индекс МосБиржи информационных технологий полной доходности | MEITTRN | Индекс МосБиржи информационных технологий полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | MEITTRR | Индекс МосБиржи информационных технологий полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) | RUB |
| MOEX IT Total Return Index | MOEX IT Net Total Return (Non-Resident) Index | MOEX IT Net Total Return (Resident) Index |
| RTSit | RUITTR | Индекс РТС информационных технологий полной доходности | RUITTRN | Индекс РТС информационных технологий полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций) | RUITTRR | Индекс РТС информационных технологий полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций) | USD |
| RTS IT Total Return Index | RTS IT Net Total Return (Non-Resident) Index | RTS IT Net Total Return (Resident) Index |

**Начальные параметры Индексов полной доходности Московской Биржи**

| **Код Индекса** | **Начальное значение** | **Дата первого расчета** |
| --- | --- | --- |
| MCFTR | 552,22 | 30.12.2004 |
| MCFTRN |
| MCFTRR |
| RTSTR | 614,11 | 31.12.2004 |
| RTSTRN |
| RTSTRR |
| MCFCNYTR | 1000 | 30.12.2022 |
| MCFCNYTRN |
| MCFCNYTRR |
| MCFWTR | 5101,91 | 20.12.2019 |
| MCFWTRN | 4714,13 |
| MCFWTRR | 4811,92 |
| MCF2TR\* | 6148,04 | 16.06.2023 |
| MCF2TRN\* | 5466,17 |
| MCF2TRR\* | 5586,45 |
| MEBCTR | 6 285,76 | 23.04.2009 |
| MEBCTRN |
| MEBCTRR |
| MRBCTR | 1000 | 29.12.2017 |
| MESMTR | 896,03 | 30.12.2013 |
| MESMTRN |
| MESMTRR |
| RUSMTR | 1281,96 | 30.12.2013 |
| RUSMTRN |
| RUSMTRR |
| MEOGTR | 3491,14 | 30.12.2013 |
| MEOGTRN |
| MEOGTRR |
| RUOGTR | 206,41 | 30.12.2013 |
| RUOGTRN |
| RUOGTRR |
| MEEUTR | 1032,39 | 30.12.2013 |
| MEEUTRN |
| MEEUTRR |
| RUEUTR | 79,59 | 30.12.2013 |
| RUEUTRN |
| RUEUTRR |
| METLTR | 2402,69 | 30.12.2013 |
| METLTRN |
| METLTRR |
| RUTLTR | 224,33 | 30.12.2013 |
| RUTLTRN |
| RUTLTRR |
| MEMMTR | 2264,99 | 30.12.2013 |
| MEMMTRN |
| MEMMTRR |
| RUMMTR | 144,99 | 30.12.2013 |
| RUMMTRN |
| RUMMTRR |
| MEFNTR | 5362,37 | 30.12.2013 |
| MEFNTRN |
| MEFNTRR |
| RUFNTR | 283,78 | 30.12.2013 |
| RUFNTRN |
| RUFNTRR |
| MECNTR | 6245,95 | 30.12.2013 |
| MECNTRN |
| MECNTRR |
| RUCNTR | 431,02 | 30.12.2013 |
| RUCNTRN |
| RUCNTRR |
| MECHTR | 6468,1 | 30.12.2013 |
| MECHTRN |
| MECHTRR |
| RUCHTR | 205,72 | 30.12.2013 |
| RUCHTRN |
| RUCHTRR |
| METNTR | 1375,42 | 30.12.2013 |
| METNTRN |
| METNTRR |
| RUTNTR | 102,36 | 30.12.2013 |
| RUTNTRN |
| RUTNTRR |
| MERETR | 5000 | 20.03.2020 |
| MERETRN |
| MERETRR |
| RURETR | 150 | 20.03.2020 |
| RURETRN |
| RURETRR |
| MEITTR | 5000 | 25.12.2020 |
| MEITTRN |
| MEITTRR |
| RUITTR | 150 | 25.12.2020 |
| RUITTRN |
| RUITTRR |

Периодичность расчета индексов полной доходности – 1 раз в день.

\* - Индексы полной доходности MCF2TR, MCF2TRN и MCF2TRR рассчитываются по итогам всего торгового дня, включая дополнительные торговые сессии, в случае их проведения.