

УТВЕРЖДЕНА

Правлением ПАО Московская Биржа
«18» января 2021 года, Протокол № 2

Председатель Правления
ПАО Московская Биржа

_____ Ю.О. Денисов

Методика расчета Индексов акций Московской Биржи

Москва, 2021

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ	3
1.1. Термины и определения	3
1.2. Семейство Индексов	4
2. РАСЧЕТ ИНДЕКСОВ	4
2.1. Общий порядок расчета ценовых Индексов	4
2.2. Общий порядок расчета Индексов полной доходности	5
2.3. Порядок расчета Индексов полной доходности "брутто"	6
2.4. Порядок расчета Индексов полной доходности "нетто"	6
2.5. Определение цены Акции	7
2.6. Определение количества акций и коэффициентов free-float	8
2.7. Определение коэффициента ликвидности и дополнительного весового коэффициента	9
2.8. Расчет весовых коэффициентов	10
2.9. Расчет Делителя	10
3. ФОРМИРОВАНИЕ И ПЕРЕСМОТР БАЗ РАСЧЕТА ИНДЕКСОВ	11
3.1. Принципы формирования Баз расчета	11
3.2. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка	11
3.3. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС	12
3.4. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса средней и малой капитализации	13
3.5. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса голубых фишек	14
3.6. Алгоритм формирования Баз расчета Отраслевых Индексов	15
3.7. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций	15
3.8. Порядок пересмотра баз расчета	16
3.9. Учет корпоративных событий	16
4. РЕГЛАМЕНТ РАСЧЕТА И РАСКРЫТИЯ ИНФОРМАЦИИ ОБ ИНДЕКСАХ	18
4.1. Индексный комитет	18
4.2. Расписание расчета	18
4.3. Контроль за расчетом Индексов	19
4.4. Раскрытие информации	19
ПРИЛОЖЕНИЕ 1	20
ПРИЛОЖЕНИЕ 2	22
ПРИЛОЖЕНИЕ 3	23
ПРИЛОЖЕНИЕ 4	25
ПРИЛОЖЕНИЕ 5	27
ПРИЛОЖЕНИЕ 6	28

1. Общие положения

1.1. Термины и определения

1.1.1. 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 Акции в Базе расчета, выраженная в процентах.
- Эмитент - эмитент обыкновенных, привилегированных или представляемых акций.

1.1.2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных иными внутренними документами Биржи, а также законами и иными нормативными актами Банка России.

1.2. Семейство Индексов

- 1.2.1. 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.
- 1.2.2. 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.
- 1.2.3. «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).
- 1.2.4. Методика, а также изменения и дополнения к ней разрабатываются с учетом рекомендаций Индексного комитета.
- 1.2.5. 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.
- 1.2.6. Текст утвержденной Методики раскрывается Биржей не позднее, чем за две недели до даты вступления ее в силу.

2. Расчет Индексов

2.1. Общий порядок расчета ценовых Индексов

- 2.1.1. 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:

I_n – значение Индекса на n -ый момент расчета;

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

D_n – 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:

MC_1 – суммарная стоимость (капитализация) всех Акций на дату первого произведенного расчета Индекса;

I_1 – значение Индекса на дату первого произведенного расчета.

В последующие дни Делитель остается без изменений ($D_n = D_{n-1}$), кроме случаев, описанных в п.2.9.

- 2.1.2. Дата первого произведенного расчета каждого Индекса, а также значения I_1 , MC_1 , D_1 на дату первого произведенного расчета, указаны в Приложении 2 к Методике.
- 2.1.3. 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;

MC_i – капитализация i -той Акции.

- 2.1.4. Стоимость (капитализация) i -той Акции, рассчитывается по формуле:

$$MC_i = \frac{P_i \cdot Q_i \cdot FF_i \cdot W_i}{K_n},$$

где:

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

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

FF_i – Коэффициент free-float i -ой Акции;

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

K_n – 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.

- 2.1.5. Капитализация Эмитента рассчитывается как сумма капитализаций Акций всех категорий данного Эмитента.

- 2.1.6. Для информационных целей может рассчитываться цена P_{ci} i -той акции, выраженная в валюте, по формуле:

$$P_{ci} = \frac{MC_i}{Q_i \cdot FF_i \cdot W_i},$$

где:

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

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

FF_i – Коэффициент free-float i -ой Акции;

W_i – Весовой коэффициент.

- 2.1.7. Значения капитализации MC_i , рассчитывается с точностью до четырех знаков после запятой.

- 2.1.8. Значения Индексов выражаются в пунктах и рассчитываются с точностью до двух знаков после запятой.

2.2. Общий порядок расчета Индексов полной доходности

- 2.2.1. 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.

- 2.2.2. Дивиденды учитываются при расчете Индексов полной доходности в торговый день, предшествующий дате, на которую в соответствии законодательством определяются лица, имеющие право на получение дивидендов (далее – Дата закрытия реестра). Если Дата закрытия реестра не является торговым днем, дивиденды учитываются в торговый день, на два торговых дня предшествующий Дате закрытия реестра.

- 2.2.3. Если информация о решениях Эмитента Акций в отношении выплаты дивидендов получена Биржей после даты, когда дивиденды должны быть учтены в соответствии с п.2.2.2, то дивиденды учитываются в день получения Биржей указанной информации.

- 2.2.4. Источниками данных о выплате дивидендов являются информационные агентства, уполномоченные на раскрытие информации, Эмитенты ценных бумаг.

- 2.2.5. Дата первого произведенного расчета каждого Индекса полной доходности и значение в первый день его расчета указаны в Приложении 6 к Методике.

- 2.2.6. 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.

2.2.7. Значения Индексов полной доходности выражаются в пунктах и рассчитываются с точностью до двух знаков после запятой.

2.3. Порядок расчета Индексов полной доходности "брутто"

2.3.1. Величина дивидендов, учитываемых при расчете Индексов полной доходности, определяется по формуле:

$$TD_n = \sum_{i=1}^N \frac{Div_{in} \cdot Q_{in} \cdot FF_{in} \cdot W_{in}}{K_n},$$

где:

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

N – число Акций в Базе расчета соответствующего Индекса;

Div_{in} – размер дивидендов по i -той Акции в рублях;

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

FF_{in} – Коэффициент free-float i -ой Акции, используемый в Базе расчета соответствующего Индекса в день n ;

W_{in} – весовой коэффициент, используемый в Базе расчета соответствующего Индекса в день n ;

K_n – 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.

2.3.2. Дивиденды "брутто", выраженные в пунктах Индексов полной доходности:

$$ID_n = \frac{TD_n}{D_n},$$

где:

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

2.3.3. Доходность "брутто" в результате реинвестирования дивидендов определяется по формуле:

$$TR_n = \frac{I_n + ID_n}{I_{n-1}},$$

где:

I_n – значение ценового Индекса в день n ;

I_{n-1} – значение ценового Индекса в день $n-1$.

2.3.4. Значение Индекса полной доходности "брутто" определяется по формуле:

$$ITR_n = ITR_{n-1} \cdot TR_n.$$

2.4. Порядок расчета Индексов полной доходности "нетто"

2.4.1. Величина дивидендов, учитываемых при расчете Индекса полной доходности "нетто", определяется по формуле:

$$TDnet_n = (1 - \frac{TAX}{100}) \cdot TD_n ,$$

где:

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

TD_n – величина дивидендов "брутто";

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

- 2.4.2. Дивиденды "нетто", выраженные в пунктах Индекса полной доходности:

$$IDnet_n = \frac{TDnet_n}{D_n} ,$$

где:

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

- 2.4.3. Доходность "нетто" в результате реинвестирования дивидендов определяется по формуле:

$$TRnet_n = \frac{I_n + IDnet_n}{I_{n-1}} ,$$

где:

I_n – значение ценового Индекса в день n ;

I_{n-1} – значение ценового Индекса в день $n-1$.

- 2.4.4. Значение Индекса полной доходности "нетто" определяется по формуле:

$$ITRnet_n = ITRnet_{n-1} \cdot TRnet_n ,$$

2.5. Определение цены Акции

- 2.5.1. Для определения цены i -ой Акции (P_i) 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 Режимы основных торгов $T+$;
- цены закрытия Акции.

- 2.5.2. 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.

- 2.5.3. Цена i -ой Акции (P_i) устанавливается равной цене последней сделки, совершенной на торгах Биржи с данной Акцией (P_{it}^{deal}), кроме случаев, предусмотренных пунктами 2.5.4 - 2.5.5 настоящей Методики

$$P_i = P_{it}^{deal} ,$$

- 2.5.4. Для устранения нерыночных колебаний цен ценных бумаг рассчитывается величина отклонения цены каждой сделки от средневзвешенной цены предыдущих 10 сделок. Если цена последней сделки (P_{it}^{deal}) отклоняется от средневзвешенной цены предыдущих 10 сделок на величину, превышающую установленное значение, то вместо цены последней сделки (P_{it}^{deal}) используется предыдущее значение цены (P_{it-1}), удовлетворяющее данному условию:

$$P_i = P_{it-1}, \text{ если } \left| \frac{P_{it}^{deal}}{P_{it}^{avg}} - 1 \right| > F_i ,$$

где:

P_{it-1} – цена i -ой Акции в момент совершения предыдущей сделки $t-1$;

P_{it}^{deal} – цена последней сделки в момент t ;

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

P_{it}^{avg} – средневзвешенная цена 10 последних сделок, определяемая по формуле:

$$P_{it}^{avg} = \frac{\sum_{f=t-10}^{t-1} P_{if}^{deal} \cdot q_{if}}{\sum_{f=t-10}^{t-1} q_{if}},$$

где:

P_{if}^{deal} – цена f -ой сделки;

q_{if} – 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 (P_i) устанавливается равной цене последней сделки, совершенной с данной Акцией (P_{it}^{deal}).

- 2.5.5. Цена i -ой Акции (P_i) на момент окончания основной торговой сессии равна цене закрытия.
- 2.5.6. 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.
- 2.5.7. Цена i -ой Акции (P_i) определяется с точностью до величины шага цены, установленного для данной Акции в Правилах проведения торгов на фондовом рынке и рынке депозитов.
- 2.5.8. Порядок определения цены i -ой Акции (P_i), установленный пунктами 2.5.1 – 2.5.6 настоящей Методики, не применяется в случае, предусмотренном п.3.9.4 настоящей Методики.

2.6. Определение количества акций и коэффициентов free-float

- 2.6.1. В целях настоящей Методики общее количество акций (Q_i) 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 (Q_i) определяется как суммарное количество представляемых акций, разделенное на количество представляемых акций, право собственности на которые удостоверяется одной депозитарной расписки данного выпуска.
- 2.6.2. Общее количество i -ых Акций (Q_i) рассчитывается по итогам торгового дня, предшествующего дню раскрытия информации об изменении Базы расчета, за исключением случаев, предусмотренных п.3.9.4 настоящей Методики.
- 2.6.3. Значение Коэффициента free-float (FFi) определяется на основании информации, раскрываемой Эмитентами ценных бумаг, а также на основании иной публично доступной информации о владельцах акций и/или представляемых акций Эмитента, в том числе бенефициарных владельцах.
- 2.6.4. Общее количество акций определяется, как количество размещенных и/или представляемых акций Эмитента одной категории, типа, по информации на дату произведения расчёта. Количество акций в свободном обращении определяется путем вычитания из общего количества акций Эмитента количества акций, не находящихся в свободном обращении. Значение Коэффициента free-float определяется, как отношение количества акций в свободном обращении к общему количеству акций Эмитента.
- 2.6.5. Утверждение значений Коэффициентов free-float осуществляется с учетом рекомендаций Индексного комитета один раз в квартал не позднее первого четверга марта, июня, сентября, декабря. Значение Коэффициента free-float может быть утверждено в иные сроки в случае получения информации о значительном изменении структуры владения акционерным капиталом, а также в случае включения Акций в котировальные списки Биржи или Сектор Роста.
- 2.6.6. Если действующее значение Коэффициента free-float превышает 15%, корректировка Биржей оценки Коэффициента free-float может не производиться в случае, если его изменение по сравнению с действующим значением не превышает 2 процентных пункта.

- 2.6.7. 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.

2.7. Определение коэффициента ликвидности и дополнительного весового коэффициента

- 2.7.1. Для всех Акции рассчитывается коэффициент ликвидности LC_i :

$$LC_i = \frac{Median(V_i)}{Average(P_i \cdot Q_i) \cdot FF_i} \cdot WorkDays \cdot 100\%,$$

где

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

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

$Average(P_i \cdot Q_i)$ – Средняя капитализация i-ой Акции;

FF_i – Коэффициент free-float i-ой Акции.

- 2.7.2. Для Акции, являющихся акциями иностранных Эмитентов или иностранными депозитарными расписками на акции, рассчитывается дополнительный весовой коэффициент LW_i . Дополнительный весовой коэффициент Акции принимает значение от 0 до 1 в соответствии с таблицей, в зависимости от значения коэффициента ликвидности данной Акции:

LC_i	LW_i
Менее 1,25%	0
1,25% и более, но менее 2,50%	0,12
2,5% и более, но менее 5%	0,25
5% и более, но менее 10%	0,5
10% и более	1

- 2.7.3. При пересмотре Баз расчета Индексов значение Дополнительного весового коэффициента LW_i понижается при снижении коэффициента ликвидности LC_i данной Акции ниже установленных в таблице значений:

LC_i	Новое значение LW_i
Менее 0,63%	0
Менее 1,25%	0,12
Менее 2,50%	0,25
Менее 5,00%	0,5

- 2.7.4. При пересмотре Баз расчета Индексов значение Дополнительного весового коэффициента LW_i повышается при превышении коэффициента ликвидности LC_i данной Акции выше установленных в таблице значений, но не более чем на 1 позицию:

LC_i	Новое значение LW_i
Более 1,88%	0,12
Более 3,75%	0,25
Более 7,50%	0,5
Более 15,00%	1

- 2.7.5. Изменение весового коэффициента LW_i , в соответствии с пп.2.7.3-2.7.4, осуществляется с учетом рекомендаций Индексного комитета.

2.8. Расчет весовых коэффициентов

2.8.1. Удельный вес i -ой Акции рассчитывается по следующей формуле:

$$Wght_i = \frac{MC_i}{\sum_{i=1}^N MC_i} \cdot 100\%,$$

где:

$Wght_i$ – Удельный вес i -ой Акции;

MC_i – Капитализация i -той Акции;

N – общее количество Акций.

2.8.2. Удельный вес Акций одного Эмитента рассчитывается как сумма Удельных весов Акций всех категорий данного Эмитента.

2.8.3. В целях уменьшения влияния Акций отдельных Эмитентов на значение Индексов используется весовой коэффициент WW_i , 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.

2.8.4. 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.

2.8.5. Весовой коэффициент i -ой Акции W_i , используемый при расчете Индексов, рассчитывается по следующей формуле:

$$W_i = WW_i \cdot LW_i,$$

где:

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

LW_i – коэффициент, ограничивающий долю капитализации i -ой Акции в зависимости от коэффициента ликвидности i -ой Акции.

Весовой коэффициент i -ой Акции, используемый при расчете Индекса средней и малой капитализации, рассчитывается без учета коэффициента ликвидности LW_i .

2.8.6. Значение весового коэффициента W_i i -той Акции, используемое при расчете Индекса МосБиржи голубых фишек, принимается равным значению весового коэффициента Акции, установленного для Индекса МосБиржи и Индекса РТС.

2.8.7. Весовые коэффициенты WW_i и W_i , 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.

2.9. Расчет Делителя

2.9.1. Расчет Делителя D_n осуществляется в случае изменения Базы расчета, Коэффициентов free-float, коэффициентов W_i , ограничивающих долю капитализации i -ых Акций (весовых коэффициентов), и (или) при наступлении корпоративных событий в случаях, предусмотренных пп. 3.9 настоящей Методики.

2.9.2. Расчет Делителя D_n осуществляется по следующей формуле:

$$D_{n+1} = D_n \cdot \frac{MC_n}{MC_n},$$

где:

D_{n+1} – новое значение Делителя D ;

D_n – текущее значение Делителя D ;

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

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

- 2.9.3. Расчет Делителя D_n осуществляется с точностью до четырех знаков после запятой по правилу математического округления.

3. Формирование и пересмотр Баз расчета Индексов

3.1. Принципы формирования Баз расчета

- 3.1.1. 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.
- 3.1.2. База расчета Индекса МосБиржи инноваций формируется на основе Акции, допущенных к торгам в Секторе Рынка инноваций и инвестиций, как это определено в п.3.7 настоящей Методики.
- 3.1.3. Базы расчета Индексов содержат наименования Эмитентов Акции, а также указания на категорию (тип) ценных бумаг (для акций), наименования Эмитентов представляемых ценных бумаг (для депозитарных расписок).
- 3.1.4. По рекомендации Индексного комитета Биржей может быть принято решение о включении в Базу расчета Индексов (исключении из Базы расчета) Акции, 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.
- 3.1.5. Биржей может быть принято решение об исключении из Базы расчета Индексов Акции 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 Акции в порядке, установленном в разделе 2.6 настоящей Методики и Методике расчета Коэффициента free-float, утвержденной Биржей.

3.2. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка

- 3.2.1. База расчета Индекса акций широкого рынка включает 100 Акции, если иное не установлено Биржей. При этом База расчета Индекса акций широкого рынка должна включать Акции не менее 10 Эмитентов.
- 3.2.2. В Базу расчета Индексов акций широкого рынка включаются Акции, прошедшие процедуру листинга на Бирже.
- 3.2.3. 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 Акции.
- 3.2.4. 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.
- 3.2.5. Из Базы расчета Индекса акций широкого рынка могут быть исключены Акции, которые были включены в текущий Лист ожидания на исключение.
- 3.2.6. 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 LC_i не менее 1%.
- 3.2.7. Для целей формирования Базы расчета предварительно составляется список из 120 Акции, соответствующих пп.3.2.2, 3.2.4 и 3.2.6 с наибольшим значением Медианного объема торгов, если иные требования не установлены Биржей.
- 3.2.8. База расчета Индекса акций широкого рынка формируется из Акции, 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 с присвоением условного порядкового номера.
 - Включаются Акции, имеющие порядковый номер на 5 или более позиций меньше числа Акции 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 Акции в текущей Базе расчета Индекса акций широкого рынка.
- 3.2.9. В случае несоблюдения требований п.3.2.1 после формирования Базы расчета Индекса акций широкого рынка, в соответствии с п.3.2.8, в Базу (из Базы) расчета Индекса акций широкого рынка включаются (исключаются) Акции, входящие в Лист ожидания на включение (исключение) и имеющие наибольшую (наименьшую) Среднюю капитализацию с учетом актуального Коэффициента free-float.
- 3.2.10. Новый состав Листа ожидания на исключение формируется из Акции, входящих в Базу расчета Индекса акций широкого рынка и не входящих в список, указанный в п. 3.2.7.
- 3.2.11. Новый состав Листа ожидания на включение формируется из Акции, 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 Акции, ранжированных по убыванию Средней капитализации с учетом актуального Коэффициента free-float.
- 3.2.12. По рекомендации Индексного комитета Биржей может быть принято решение об увеличении до 6 месяцев срока нахождения в составе Листов ожидания Акции, являющихся акциями иностранных Эмитентов или иностранными депозитарными расписками на акции.

3.3. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС

- 3.3.1. База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включает 50 Акции, если иное не установлено Биржей. База расчета может включать меньшее число Акции, если в ходе ее формирования окажется, что количество Акции, соответствующих предъявляемым настоящей Методикой требованиям, составляет менее 50. При этом База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС должна включать Акции не менее 10 Эмитентов.
- 3.3.2. База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также Лист ожидания на включение в соответствующие Индексы формируются из Акции, включенных в котировальные списки Биржи, если иное не установлено Биржей в случае получения соответствующих рекомендаций Индексного комитета.
- 3.3.3. В новую Базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включаются Акции, входящие в один из следующих списков:
- В текущую Базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС;
 - В текущий Лист ожидания на включение;
 - Публично размещенные и впервые предложенные к публичному обращению Акции;
 - Публично размещенные путем вторичной публичной продажи Акции.
- 3.3.4. В Базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС 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 Ациями была совершена хотя бы одна сделка, от общего числа торговых дней за шесть месяцев, предшествующих Дню формирования Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, составляет не менее 99%;
 - значение коэффициента LC_i составляет не менее 15% (1% для Акции иностранных Эмитентов и депозитарных расписок на Акции, при условии, что коэффициент ликвидности, рассчитанный по объему торгов на площадке первичного листинга, составляет не менее 15%);
 - Эмитент Акции раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой не более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС.

- 3.3.5. Из Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС могут 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 Индекса МосБиржи и Индекса РТС, составляет менее 90%;
 - значение коэффициента LC_i составляет менее 10% (1% для Акции иностранных Эмитентов и депозитарных расписок на Акции, при условии, что коэффициент ликвидности, рассчитанный по объему торгов на площадке первоначального листинга составляет менее 10%);
 - Эмитент Акции раскрыл последнюю отчетность в международном формате с задержкой более 8 месяцев, предшествующих Дню формирования новой Базы расчета.
- 3.3.6. Новая База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС формируется по следующему алгоритму:
- Из Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС исключаются Акции, у которых значение Коэффициента free-float составляет менее 5% или которые были исключены из Базы расчета Индекса широкого рынка;
 - Из Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС исключаются Акции, которые ранее были включены в Лист ожидания на исключение и показатели которых соответствуют требованиям п.3.3.5.
 - Для оставшихся Акции, входящих в База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также Акции, входящих в списки, обозначенные в п.3.3.3, показатели которых соответствуют п. 3.3.4, рассчитываются весовые коэффициенты W_i 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 LW_i .
 - В База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС включаются Акции, Удельный вес которых составляет более 0,25%, и которые были включены в База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС или Листы ожидания на включение.
 - Из Базы расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС исключаются Акции, Удельный вес которых составляет менее 0,2%, и которые были включены в Лист ожидания на исключение.
- 3.3.7. Новый состав Листа ожидания на исключение формируется из Акции, входящих в База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, а также соответствующих критериям п.3.3.5 или Удельным весом менее 0,2%.
- 3.3.8. Новый состав Листа ожидания на включение формируется из Акции, не входящих в База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС и соответствующих критериям п. 3.3.4, при условии, что потенциальный Удельный вес Акции в База расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС превышает 0,2%. В Лист ожидания включается не более 10 таких Акции, ранжированных по убыванию Средней капитализации с учетом актуального Коэффициента free-float и дополнительного весового коэффициента LW_i .

3.4. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса средней и малой капитализации

- 3.4.1. Количество Акции в База расчета Индексов средней и малой капитализации – переменное.
- 3.4.2. База расчета Индекса средней и малой капитализации формируется из Акции, включенных в котировальные списки Биржи, кроме Акции эмитентов, осуществляющих виды деятельности, относящиеся к финансовой отрасли в соответствии с Приложением 4, если иное не установлено Биржей.
- 3.4.3. В новую База расчета Индекса средней и малой капитализации включаются Акции, входящие в новую База расчета Индекса акций широкого рынка.
- 3.4.4. 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 S_R :

$$S_R = \frac{\sum_{j=1}^R MC_j}{\sum_{j=1}^M MC_j},$$

где

R – порядковый номер Эмитента;

M – общее количество Эмитентов;

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

- 3.4.5. Параметру *r* присваивается значение порядкового номера R последнего по счету Эмитента, у которого значение коэффициента *S_R*, 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 *S_R* составляет меньше 85%.
- 3.4.6. 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 LC_i 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
- 3.4.7. 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 LC_i 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;
- 3.4.8. 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, с учетом актуального Коэффициента free-float;
 - 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.
- 3.4.9. 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.

3.5. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса голубых фишек

- 3.5.1. База расчета Индекса голубых фишек включает 15 Акций, если иное не установлено Биржей. В Индекс голубых фишек может быть включен только один тип акций одного эмитента.
- 3.5.2. База расчета Индекса голубых фишек формируется из Акций, входящих в Базу расчета Индекса МосБиржи и Индекса РТС, 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 LW_i и актуального Коэффициента free-float при этом первой в списке категории Акции каждого Эмитента присваивается порядковый номер, остальным категориям Акции 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.

3.6. Алгоритм формирования Баз расчета Отраслевых Индексов

- 3.6.1. Количество Эмитентов Акции в Базе расчета отраслевого Индекса не должно быть меньше трех, если иное не установлено Биржей.
- 3.6.2. 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 Весового коэффициента W_i , 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 Весового коэффициента W_i , составляет более 0,6%.

3.7. Алгоритм формирования Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций

- 3.7.1. Количество Акции в Базе расчета Индекса МосБиржи инноваций – переменное.
- 3.7.2. В Базу расчета Индекса МосБиржи инноваций включаются Акции, допущенные к торгам в Секторе Рынка инноваций и инвестиций.
- 3.7.3. 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.
- 3.7.4. Из Базы расчета Индекса МосБиржи инноваций могут быть исключены Акции в случаях возникновения событий, предусмотренных п.3.8.4.
- 3.7.5. 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%.
- 3.7.6. На основании субъективной (экспертной) оценки формируется список не более чем из 30 Акции, соответствующих п. 3.7.2 и 3.7.5, с максимальным значением Медианного объема торгов, если иные требования не установлены Биржей.
- 3.7.7. База расчета Индекса МосБиржи инноваций формируется из Акции, 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.

- 3.7.8. На основании субъективной (экспертной) оценки Биржей может быть принято решение о включении в Базу расчета (исключении из Базы расчета) Индекса МосБиржи инноваций Акции, 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.

3.8. Порядок пересмотра баз расчета

- 3.8.1. Включение Акции в Базы расчета и исключение Акции из Баз расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета.
- 3.8.2. 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.
- 3.8.3. Формирование Баз расчета при очередном пересмотре производится в соответствии с пп. 3.1-3.7 настоящей Методики.
- 3.8.4. Внеочередной пересмотр Баз расчета может быть осуществлен в случае возникновения следующих событий:
- при исключении Акции 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.
- 3.8.5. 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.
- 3.8.6. Информационные сообщения о внеочередном пересмотре Баз расчета раскрываются не позднее дня, предшествующего дате вступления в силу новых Баз расчета.

3.9. Учет корпоративных событий

- 3.9.1. 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.
- 3.9.2. 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 последней рассчитанной перед приостановкой торгов цене.
- 3.9.3. 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 (Q_i). Указанный пересчет осуществляется в установленном порядке в срок, предусмотренный пунктом 2.6.1 настоящей Методики.
- 3.9.4. 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 (Q_i), а также цены i -той акции (P_i), рассчитанной по итогам торгового дня, предшествующего указанной дате. В ходе такого пересчета общее количество i -ых акций (Q_i) умножается на коэффициент дробления или делится на коэффициент консолидации, а цена i -той акции (P_i) делится на коэффициент дробления или умножается на коэффициент консолидации.
- 3.9.5. 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.

3.9.6. Примерный порядок действий при реорганизации акционерных обществ, акции которых включены в Базу расчета:

3.9.6.1. 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.

3.9.6.2. 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.

3.9.6.3. Реорганизация акционерного общества в форме выделения

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

3.9.6.4. 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) (P_i) фиксируется на уровне, определенном по итогам торгового дня, предшествующего дате фиксации. Дата фиксации цены i -ой акции (P_i), а также условия прекращения фиксации цены i -ой акции (P_i) определяются Биржей с учетом рекомендаций Индексного комитета. В дату прекращения фиксации цены i -ой акции (P_i) осуществляется пересчет общего количества i -ых акций (Q_i) и Делителя D .

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

3.9.6.5. 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.

4. Регламент расчета и раскрытия информации об Индексах

4.1. Индексный комитет

4.1.1. 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.

4.1.2. 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.

4.2. Расписание расчета

4.2.1. 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.

4.2.2. Расчет Индексов осуществляется в течение основной торговой сессии. Расчет отдельных Индексов, указанных в Приложении 1, также осуществляется в течение дополнительной торговой сессии (в случае ее проведения). Перечень Индексов, расчет которых осуществляется в течение дополнительной торговой сессии, может быть изменен решением Биржи, с учетом требований, установленных нормативными актами Банка России.

4.2.3. Первые значения Индексов, публикуемые в течение основной торговой сессии, являются значениями открытия соответствующего Индекса соответствующего торгового дня.

- 4.2.4. Последние значения Индексов, публикуемые в течение основной торговой сессии, являются значениями закрытия соответствующего Индекса соответствующего торгового дня.
- 4.2.5. 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.

4.3. Контроль за расчетом Индексов

- 4.3.1. 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, но не ранее, чем за предыдущий торговый день. 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.
- 4.3.2. 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.

4.4. Раскрытие информации

- 4.4.1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой и нормативными актами Банка России, осуществляется на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
- 4.4.2. 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.
- 4.4.3. 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 Акции (Q_i) по каждой i -ой Акции,
 - Удельный вес i -ой Акции по каждой i -ой Акции,
 - Значения закрытия Индексов,
 - Значения курса рубля к доллару США, использованному при расчете соответствующего значения Индекса.
- 4.4.4. Текущие значения Индексов раскрываются в течение 2 минут с момента их расчета.
- 4.4.5. Настоящая Методика, информация о значениях закрытия Индексов, об общем количестве i -ых Акции (Q_i) по каждой i -ой Акции, об Удельном весе i -ой Акции по каждой i -ой Акции доступны любому заинтересованному лицу на официальном сайте Биржи в сети Интернет за последние 2 года.
- 4.4.6. 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*	Индекс МосБиржи	MOEX Russia Index	RUB	1 раз в секунду в течение основной и дополнительной торговых сессий
RTSI	Индекс РТС	RTS Index	USD	
MOEXBC	Индекс МосБиржи голубых фишек	MOEX Blue Chip 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	

Код Индекса	Наименование Индекса	Наименование Индекса на английском языке	Валюта	Периодичность расчета
RTStn	Индекс РТС транспорта	RTS Transport Index	USD	1 раз в 15 секунд в течение основной торговой сессии
MOEXRE	Индекс МосБиржи строительных компаний	MOEX Real Estate Index	RUB	1 раз в день
RTSre	Индекс РТС строительных компаний	RTS Real Estate Index		
MOEXIT	Индекс МосБиржи информационных технологий	MOEX IT Index	USD	1 раз в день
RTSit	Индекс РТС информационных технологий	RTS IT Index		

* В отношении Индекса МосБиржи во время дополнительной торговой сессии (в случае ее проведения) наряду с кодом «IMOEX» может также использоваться код «IMOEX2».

Приложение 2
к Методике расчета Индексов Московской Биржи

Начальные параметры ценовых Индексов Московской Биржи

Код Индекса	Начальное значение I_1 (I_{c1})	Дата первого расчета	Начальное значение MC_1 (MC_{c1})	Начальное значение D_1 (D_{c1})
IMOEX	100	22.09.1997	240 287 712 872,71 p.	2 402 877 128,73
RTSI	100	01.09.1995	12 666 080 264 \$	126 660 802,64
MOEXBMI	1000	30.12.2011	5 714 921 368 642,70 p.	5 714 921 368,6427
RUBMI	1000	30.12.2011	178 017 187 340,90 \$	178 017 187,3409
MCXSM	1000	17.12.2012	249 935 428 677 p.	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 p.	292 180 756,7998
MOEXINN	1000	29.12.2009	428 041 076,70 p.	428 041,0767
MOEXOG	1000	30.12.2004	53 793 633 597,22 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	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 p.	390 257 291,3457
RTSit	150	25.12.2020	26 299 610 573,94 \$	175 330 737,1597

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:

Код Индекса	Величина ограничения, %
IMOEX, RTSI, MOEXBMI, RUBMI, MOEXOG, RTSog, MOEXEU, RTSeu, MOEXMM, RTSmm, MOEXCN, RTScr	15
MOEXBC	20
MOEXFN, RTSfn	25
MOEXINN	30

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

- IMOEX
- RTSI

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

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, %
MCXSM RTSSM	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
MOEXMM, RTSmm	Металлы и добыча	Производство химических веществ специального назначения
		Производство алюминия
		Диверсифицированные металлургические и добывающие компании, включая добычу коксующегося угля
		Добыча меди
		Добыча золота
		Добыча драгоценных металлов и минералов
		Добыча серебра
-	Промышленность*	Производство стали
		Аэрокосмическая и оборонная промышленность
		Производство строительных изделий
		Строительство и монтаж инженерного оборудования
		Производство электрооборудования
		Деятельность по управлению финансово-промышленными группами и холдинг-компаниями
		Машиностроение
MOEXTN, RTStn	Транспорт	Торговые компании и дистрибьюторы
		Грузовые перевозки воздушным транспортом и логистика
		Деятельность воздушного транспорта
		Деятельность морского транспорта
		Деятельность автомобильного и железнодорожного транспорта
MOEXCN, RTScr	Потребительский сектор	Транспортная инфраструктура
		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
MOEXFN, RTSfn	Финансы	Здравоохранение
		Банковская деятельность
		Диверсифицированные финансовые услуги
MOEXTL, RTStl	Телекоммуникации	Страхование
		Предоставление разнообразных услуг в области телекоммуникаций
		Предоставление услуг беспроводной связи

Индексы	Отрасль	Вид деятельности
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	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						Периодич- ность расчета	Валюта расчета	Дата первого расчета	Началь- ное значе- ние
	«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	1 раз в день	RUB	30.12.2004	552,22
		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	31.12.2004	614,11
		Индекс PTC полной доходности		Индекс PTC полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций)		Индекс PTC полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций)				
MOEXBC	MEBCTR	MOEX Blue Chip Total Return Index	MEBCTRN	MOEX Blue Chip Net Total Return (Non- Resident) Index	MEBCTR	MOEX Blue Chip Net Total Return (Resident) Index		RUB	23.04.2009	6 285,76
		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)				
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	30.12.2013	896,03
		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	30.12.2013	1281,96
		Индекс PTC средней и малой капитализации полной доходности		Индекс PTC средней и малой капитализации полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций)		Индекс PTC 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	30.12.2013	3491,14
		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	30.12.2013	206,41
		Индекс PTC нефти и газа полной доходности		Индекс PTC нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам иностранных организаций)		Индекс PTC нефти и газа полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций)				

Код ценового Индекса	Индексы полной доходности						Периодич- ность расчета	Валюта расчета	Дата первого расчета	Началь- ное значе- ние
	«брутто»		«нетто», по налоговым ставкам иностранных организаций		«нетто», по налоговым ставкам российских организаций					
	Код	Наименование	Код	Наименование	Код	Наименование				
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	1 раз в день	RUB	30.12.2013	1032,39
		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	30.12.2013	79,59
		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	30.12.2013	2402,69
		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	30.12.2013	224,33
		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	30.12.2013	2264,99
		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	30.12.2013	144,99	
		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	30.12.2013	5362,37	
		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)				

Код ценового Индекса	Индексы полной доходности						Периодич- ность расчета	Валюта расчета	Дата первого расчета	Началь- ное значе- ние
	«брутто»		«нетто», по налоговым ставкам иностранных организаций		«нетто», по налоговым ставкам российских организаций					
	Код	Наименование	Код	Наименование	Код	Наименование				
RTSfn	RUFNTR	RTS Financials Total Return Index	RUFNTRN	RTS Financials Net Total Return (Non-Resident) Index	RUFNTRR	RTS Financials Net Total Return (Resident) Index	1 раз в день	USD	30.12.2013	283,78
		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	30.12.2013	283,78
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	30.12.2013	6245,95
		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	30.12.2013	431,02
		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	30.12.2013	6468,1
		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	30.12.2013	205,72
		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	30.12.2013	1375,42
		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	30.12.2013	102,36
		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	MERETR N	MOEX Real Estate Net Total Return (Non-Resident) Index	MERETR R	MOEX Real Estate Net Total Return (Resident) Index		RUB	20.03.2020	5000
		Индекс МосБиржи строительных		Индекс МосБиржи строительных компаний полной доходности «нетто»		Индекс МосБиржи строительных компаний полной доходности «нетто» (по налоговым ставкам российских организаций)				

Код ценового Индекса	Индексы полной доходности						Периодич- ность расчета	Валюта расчета	Дата первого расчета	Началь- ное значе- ние
	«брутто»		«нетто», по налоговым ставкам иностранных организаций		«нетто», по налоговым ставкам российских организаций					
	Код	Наименование	Код	Наименование	Код	Наименование				
		компаний полной доходности		(по налоговым ставкам иностранных 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	20.03.2020	150
		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	25.12.2020	5000
		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	25.12.2020	150
		RTS IT Total Return Index		RTS IT Net Total Return (Non-Resident) Index		RTS IT Net Total Return (Resident) Index				