



Индекс МосБиржи-RAEX ESG сбалансированный

Зайцева Анна Николаевна

Руководитель направления развития индексов акций
Московская Биржа
01.03.2023

■ ЦЕЛЬ СОЗДАНИЯ НОВОГО ESG-ИНДЕКСА

- Расширение линейки индексов Московской Биржи в области устойчивого развития
- Новый бенчмарк для инвестиционных фондов

■ ДЛЯ КОГО

- Управляющие компании, нацеленные на создание новых ESG-продуктов
- Широкий круг инвесторов, интересующихся ESG-повесткой

Базовые принципы

- В индекс включаются акции 15 компаний, занимающих лидирующие позиции в ESG-рэнкинге агентства RAEX-Europe.
- Формирование базы расчета осуществляется один раз в год в декабре, перерасчет параметров индекса осуществляется ежеквартально.
- Веса акций в индексе распределяются пропорционально числовым значениям ESG-рэнкинга компаний.
- Максимальные веса эмитентов в индексе устанавливаются на уровне, не превышающем величину, установленную Банком России для паевых инвестиционных фондов.

Дополнительные критерии отбора акций

- Free-float акций не ниже 10%.
- Уровень листинга – 1 или 2 котировальный список.
- Уровень ликвидности – медианный объем торгов за три месяца до дня формирования индекса не ниже 50 млн руб.

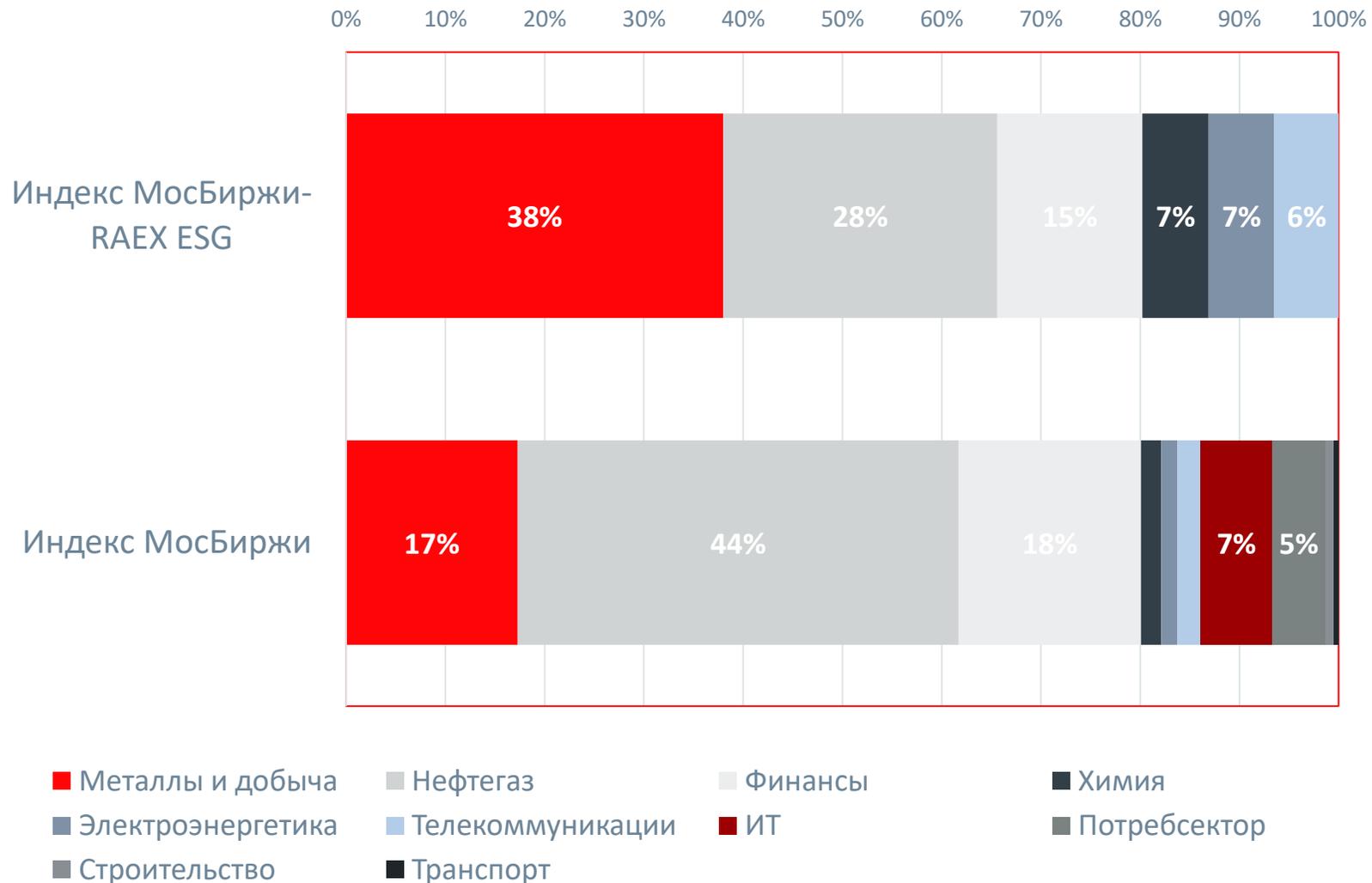
БАЗА РАСЧЕТА ИНДЕКСА МОСБИРЖИ-RAEX ESG

№	Код	Наименование ценной бумаги	Вес в индексе
1	POLY	Полиметалл Интернэшнл плс, акции иностранного эмитента	8.2%
2	SNMF	ПАО "Северсталь", ао	8.0%
3	PLZL	ПАО "Полюс", ао	8.0%
4	NLMK	ПАО "НЛМК", ао	7.8%
5	CBOM	ПАО "МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК", ао	7.3%
6	MOEX	ПАО Московская Биржа, ао	7.3%
7	RHOR	ПАО "ФосАгро", ао	6.7%
8	ENRU	ПАО "Энел Россия", ао	6.6%
9	MTSS	ПАО "МТС", ао	6.5%
10	TRNFP	ПАО "Транснефть", ап	6.1%
11	GMKN	ПАО "ГМК "Норильский никель", ао	6.0%
12	NVTK	ПАО "НОВАТЭК", ао	5.7%
13	TATNP	ПАО "Татнефть" им. В.Д. Шашина, ап	5.5%
14	GAZP	ПАО "Газпром", ао	5.3%
15	LKOH	ПАО "ЛУКОЙЛ", ао	5.2%

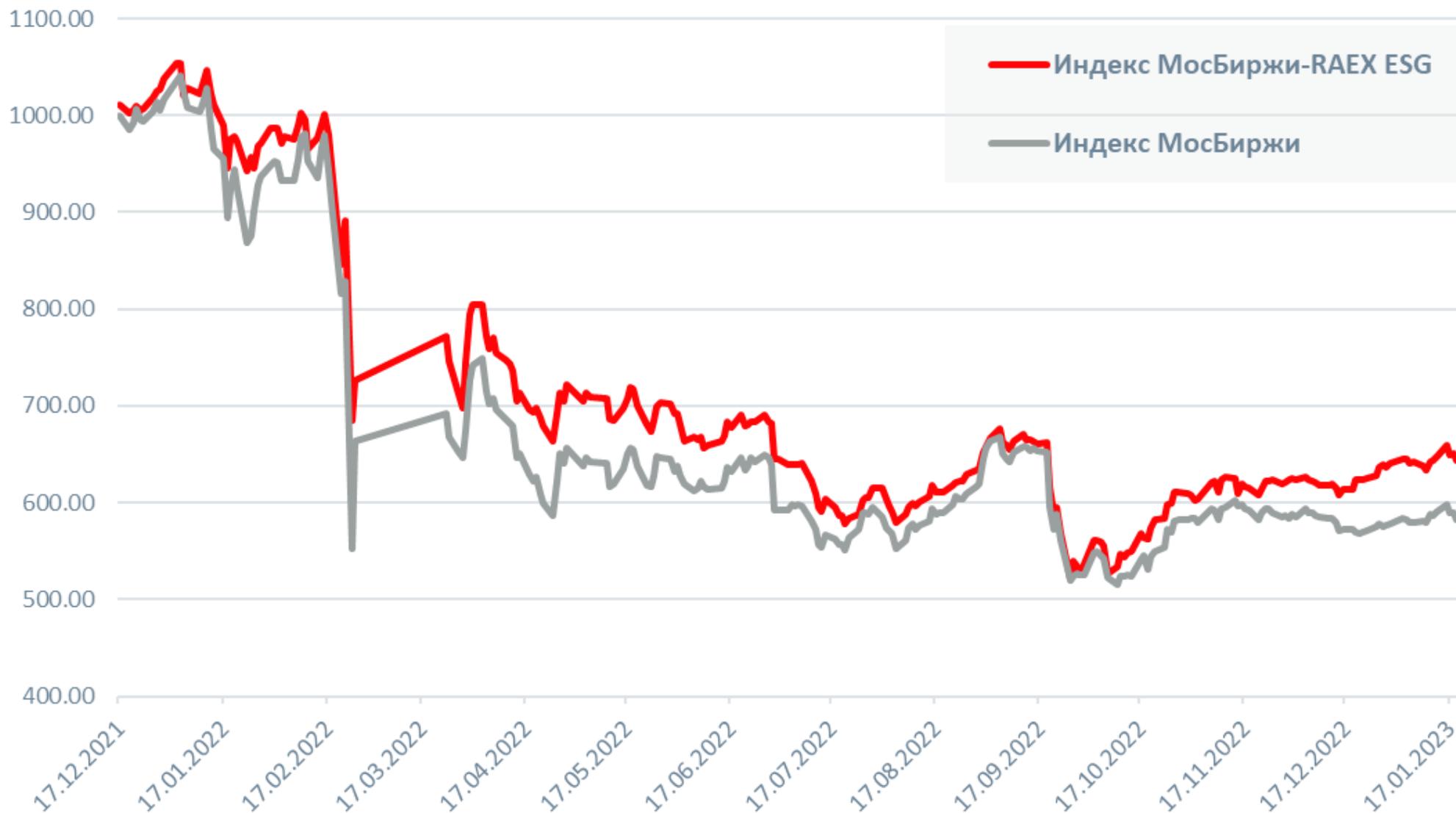
ОТРАСЛЕВАЯ ДИВЕРСИФИКАЦИЯ ИНДЕКСА МОСБИРЖИ-RAEX ESG

Уровень концентрации	Индексы	
	MESG	IMOEX
Количество эмитентов	15	40
Доля 3 отраслей	80%	80%
Доля 3 эмитентов	24%	40%

■ Несмотря на меньшее количество бумаг в индексе MESG, уровень концентрации в нем ниже, чем в индексе IMOEX



СРАВНИТЕЛЬНАЯ ДИНАМИКА ИНДЕКСОВ MESG И IMOEX



СПАСИБО!