

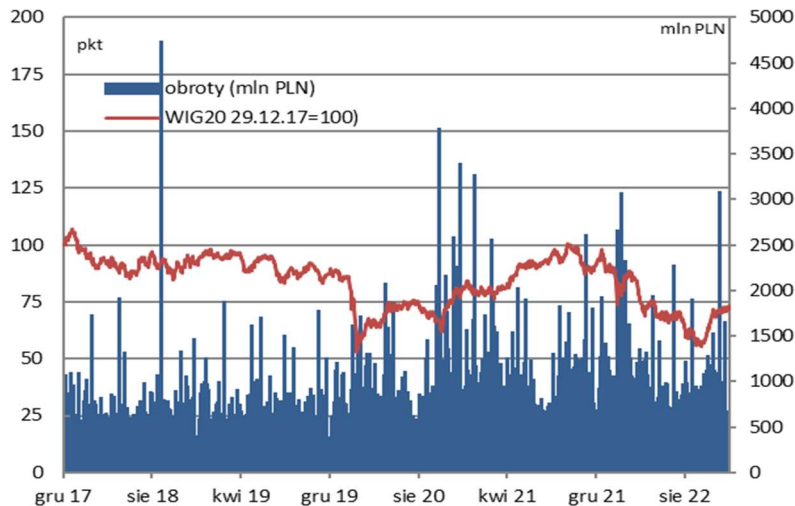
WIG20 – Metodologia indeksu

Stan na 2022-12-30



GPW Benchmark publikuje wartości 48 indeksów, w tym 41 indeksów Głównego Rynku GPW, 6 indeksów obligacji oraz 1 indeks NewConnect. Z Głównego Rynku GPW publikowane są wartości 8 indeksów głównych, 14 indeksów sektorowych, 10 indeksów strategii, 4 indeksy narodowe oraz 5 indeksów makrosektorowych. WIG20 jest indeksem blue-chip, największych i najbardziej płynnych spółek. W indeksie uczestniczy 20 spółek.

Wartości indeksu WIG20 w ostatnich 5 latach



10 największych spółek w indeksie

Spółka	Sektor	Wartość pakietu (mln PLN)	Udział w indeksie (%)
PKNORLEN	wydobycie i produkcja	30 450,40	14,628
PKOBP	banki komercyjne	25 976,49	12,479
PZU	firmy ubezpieczeniowe	20 129,36	9,670
DINOPL	artykuły codziennego użytku	17 969,36	8,632
KGHM	górnictwo metali	17 289,97	8,306
PEKAO	banki komercyjne	15 256,78	7,329
LPP	odzież i obuwie	11 150,55	5,357
ALLEGRO	Handel Internetowy	10 545,03	5,066
CDPROJEKT	Gry	9 035,13	4,340
SANPL	banki komercyjne	8 640,10	4,151
Razem:		166 443,17	79,958

Historyczne wskaźniki

Parametr	2022	2021	2020	2019	2018	2017
Stopa zwrotu PLN (%)	-20,95	14,26	-7,73	-5,56	-7,73	26,35
Stopa zwrotu EUR (%)	-22,65	13,19	-13,23	-4,61	-13,23	33,77
C/Z	7,84	12,83	42,4	12,74	42,4	14,46
C/WK	1,14	1,25	1,2	1,08	1,2	1,31
Stopa dywidendy (%)	2,5	2,1	0,5	3,2	0,5	1,9
Zmienność	29,06	17,68	28,11	14,95	28,11	14,81
Średni spread (pb)		11,13	13,02	9,57	13,02	10,79
Udział w obrotach (%)	80,62	77,1	77,07	85,72	77,07	74,23
Udział dużych transakcji w obrotach (%)*	33,26	35,18	36,14	39,76	36,14	44,35
Udział dużych transakcji w liczbie transakcji (%)*	2,4	2,94	2,69	3,41	2,69	4,65
Średnia wartość transakcji (tys. PLN)	11,01	11,77	11,01	13,14	11,01	15
Średnia wartość zlecenia (tys. PLN)	16,75	18,45	17,25	22,96	17,25	24,23

*transakcje powyżej 10 tys. EUR

Podstawowe parametry

Nazwa indeksu:	WIG20
Kod ISIN:	PL9999999987
Data bazowa:	16 kwietnia 1994 r.
Wartość bazowa:	1 000,00
Kapitalizacja bazowa:	13 632 290 000,00
Data wprowadzenia:	16 kwietnia 1994 r.

Kryteria bazowe

- liczba akcji w wolnym obrocie większa od 10%;
- wartość akcji w wolnym obrocie większa od 1 mln EUR;
- min. jedna transakcja w ostatnich 3 miesiącach;
- spółka nie może być oznaczona w sposób szczególny;
- spółka nie może być zakwalifikowana do segmentu Lista Alertów oraz znajdować się w Strefie Niskiej Płynności.

Metodologia

Uczestnikami indeksu WIG20 jest 20 spółek z najwyższą pozycją w rankingu wyznaczanym w oparciu o dane po sesji w trzeci piątek lutego, maja, sierpnia i listopada. Ranking obliczany jest na podstawie obrotów za ostatnie 12 miesięcy oraz wartości akcji w wolnym obrocie wyznaczoną w oparciu losowo wybrany kurs zamknięcia z ostatnich 5 dni sesyjnych licząc wstecz od dnia rankingu. W indeksie mogą uczestniczyć spółki, które spełniają kryterium Miesięcznego Wskaźnika Obrotu (MWO) w okresie ostatnich 12 miesięcy przed dniem rankingu. W rankingu nie uczestniczą najmniejsze spółki z ostatniego kwartyla kapitalizacji w wolnym obrocie.

Korekty okresowe dokonywane są po sesji w trzeci piątek czerwca, września i grudnia, zaś rewizja roczna, po sesji w trzeci piątek marca. Udział jednej spółki w indeksie nie może przekroczyć 15%. Pakiety spółek, których udziały są powyżej tych limitów są zmniejszane.

Pakiety akcji uczestników indeksu wyznaczane są w oparciu o liczbę akcji w wolnym obrocie i zaokrąglane do pełnych tysięcy akcji. Jeśli liczba akcji w wolnym obrocie jest wyższa niż liczba akcji wprowadzonych do obrotu, to pakiet stanowi liczba akcji wprowadzonych do obrotu.

WIG20 jest indeksem cenowym i przy jego obliczaniu nie uwzględnia się dochodów z tytułu dywidend.

Parametry publikacji

Teoretyczna wartość:	08:30 – 09:00
Otwarcie:	09:00
Bieżące wartości:	09:00 – 17:10 co 15 sek.
Zamknięcie:	17:10 (17:15 powtórzenie)

Historyczne wartości i komunikaty

Wartości indeksów: dane.historyczne@gpw.pl

Historyczne portfele: dane.historyczne@gpw.pl

Subskrypcja danych: dane.historyczne@gpw.pl

Kontakt

Pytania w sprawie metodologii: indeksy@gpwbenchmark.pl

Pytania dotyczące pochodnych: pochodne@gpw.pl

Pytania dotyczące struktur: struktury@gpw.pl

Licencje: kontakt@gpwbenchmark.pl

