

## **УТВЕРЖДЕНО**

**Приказом генерального директора**

**ООО «БСПБ Капитал»**

**№ 1-1-2021/24-1 от 12.04.2021**

### **Методика расчета индикатора «БСПБ Капитал – ОФЗ 1000»**

#### **1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ**

- 1.1. Настоящая Методика описывает расчет индикатора «БСПБ Капитал – ОФЗ 1000» (далее – Методика) и определяет порядок расчета индикатора «БСПБ Капитал – ОФЗ 1000», рассчитываемого ПАО Московская Биржа и публикуемого ООО «БСПБ Капитал» (далее – Общество).
- 1.2. Настоящая Методика, а также все изменения и дополнения в Методику утверждаются Приказом Генерального директора Общества.
- 1.3. Текст утвержденной Методики, а также изменений и дополнений в Методику, раскрываются на официальном сайте Общества в сети Интернет не позднее 2 (двух) рабочих дней за датой утверждения Методики либо изменений и дополнений в Методику, если иное не определено Приказом Генерального директора Общества.
- 1.4. Наименование индикатора: индикатор «БСПБ Капитал – ОФЗ 1000» (далее – Индикатор).

#### **2. ОБЩИЙ ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДИКАТОРА**

- 2.1. Расчет Индикатора осуществляется на основе цен сделок с государственными ценными бумагами Российской Федерации (далее – Ценные бумаги).
- 2.2. Правила расчета Индикатора, а также правила формирования Базы расчета в Приложении А к настоящей Методике.
- 2.3. Ценные бумаги, цены сделок с которыми используются при расчете Индикатора, составляют список для расчета Индикатора (далее - База расчета).
- 2.4. Порядок внесения изменений в Базу расчета и установленные весовые коэффициенты (очередные и внеочередные) определяется в Приложении А к настоящей Методике.
- 2.5. Дата начала расчета Индикатора – 04.05.2021. Начальное значение Индикатора на 04.05.2021 установлено равным 1000 пунктам.
- 2.6. Расчет Индикатора производится с точностью до двух знаков после запятой.

#### **3. ПОРЯДОК РАСКРЫТИЯ ИНФОРМАЦИИ ОБ ИНДИКАТОРЕ**

- 3.1. Информация о значении Индикатора за предыдущий торговый день раскрывается каждый торговый день не позднее 19:00 московского времени на официальном сайте Общества в сети Интернет.
- 3.2. Информация о значении Индикатора за весь период расчета, а также иная информация, в том числе раскрытие которой требуется в соответствии с требованиями нормативных актов в сфере финансовых рынков, публикуется на официальном сайте Общества в сети Интернет.
- 3.3. Сообщения Общества об очередном внесении изменений в Базу расчета и установленные весовые коэффициенты раскрываются на официальном сайте Общества в сети Интернет не позднее даты введения в действие указанных изменений.
- 3.4. Сообщения о внесении внеочередных изменений в Базу расчета и установленные весовые коэффициенты раскрываются на официальном сайте Общества в сети Интернет не позднее даты введения их в действие.

## **ПРАВИЛА РАСЧЕТА ИНДИКАТОРА «БСПБ КАПИТАЛ – ОФЗ 1000»**

### **1. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДИКАТОРА**

- 1.1. Расчет Индикатора осуществляется каждый торговый день по итогам торгового дня.
- 1.2. Расчет Индикатора производится ПАО Московская Биржа на основании настоящей методики.
- 1.3. Данные о Базе расчета Индикатора и значениях весовых коэффициентов, предоставляются Обществом.
- 1.4. В случае изменения Базы расчета и/или значений весовых коэффициентов Общество направляет ПАО Московская Биржа указанную информацию для расчета Индикатора с использованием обновленных данных.

### **2. ФОРМИРОВАНИЕ БАЗЫ РАСЧЕТА И ВНЕСЕНИЕ В НЕЕ ИЗМЕНЕНИЙ**

- 2.1. В Базу расчета могут включаться следующие облигации:
  - государственные ценные бумаги Российской Федерации.
- 2.2. Облигации, включаемые в Базу расчета, должны соответствовать следующим требованиям:
  - Валютой выпуска Облигаций являются рубли РФ.
  - Эмитент исполнил в полном объеме наступившие на дату утверждения Базы расчета обязательства по выплате купонного дохода, приобретению облигаций, погашению всех выпусков облигаций. В случае наличия у эмитента ранее неисполненного в полном объеме обязательства по допущенному ранее техническому дефолту и/или дефолту по выпуску облигаций, облигации могут быть включены в Базу расчета при условии полного исполнения эмитентом неисполненных обязательств по допущенному техническому дефолту и/или дефолту по всем выпускам облигаций.
    - Выпуск облигации входит в базу расчета одного из индексов Московской биржи.
- 2.3. База расчета, состоящая из Ценных бумаг, удовлетворяющих п.2.1 – п.2.2 настоящего Приложения, утверждается Инвестиционным комитетом Общества.
- 2.4. Очередной пересмотр Базы расчета осуществляется Обществом еженедельно, за исключением случаев, предусмотренных настоящим Приложением. Введение в действие Базы расчета осуществляется с торгового дня, следующего за днем пересмотра Базы расчета. С даты введения в действие новой Базы расчета на очередную неделю предшествующая База расчета утрачивает силу.
- 2.5. Внеочередное внесение изменений в Базу расчета осуществляется Обществом в следующих случаях:
  - 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 случае наступления иных событий, не предусмотренных настоящей Методикой, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчет Индикатора.

### **3. ПОРЯДОК РАСЧЕТА ЗНАЧЕНИЙ ВЕСОВЫХ КОЭФФИЦИЕНТОВ**

- 3.1. Значения весовых коэффициентов Ценных бумаг, входящих в Базу расчета, рассчитываются в случаях очередного или внеочередного пересмотра Базы расчета, предусмотренных разделом 2 настоящего Приложения.
- 3.2. Средневзвешенная дюрация Ценных бумаг в Базе расчета Индикатора составляет от 500 до 1500 дней.

- 3.3. Значения весовых коэффициентов для Ценных бумаг, входящих в Базу расчета и удовлетворяющих п.3.2 – п.3.2 настоящего Приложения, устанавливаются Обществом.
- 3.4. Очередной пересмотр значений весовых коэффициентов осуществляется Обществом еженедельно, одновременно с очередным пересмотром Базы расчета.
- 3.5. Внеочередной пересмотр значений весовых коэффициентов осуществляется Обществом в следующих случаях:
- в случае внеочередного внесения изменений в Базу расчета.
  - в случае наступления иных событий, не предусмотренных настоящей Методикой, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчет Индикатора.

#### 4. ФОРМУЛА РАСЧЕТА ИНДИКАТОРА

4.1. Индикатор рассчитывается по следующей формуле

$$CI_n = CI_{n-1} \cdot \frac{\sum_{i=1}^N \left( \frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,n}}{\sum_{i=1}^N \left( \frac{P_{i,n-1}}{100} \cdot FV_{i,n-1} + A_{i,n-1} \right) \cdot N_{i,n}}$$

где:

$CI_n$  – значение Индикатора в момент времени  $n$ ;

$P_{i,n}$  – средневзвешенная цена Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в процентах от номинала;

$FV_{i,n}$  – номинал Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$A_{i,n}$  – накопленный купонный доход Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$G_{i,n}$  – сумма выплаченного в день  $n$  купонного дохода по Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в рублях;

$N_{i,n}$  – количество ценных бумаг  $i$ -го выпуска Облигаций в Базе расчета момент времени  $n$ .

4.2. Расчет Дополнительных показателей осуществляется по следующим формулам:

4.2.1. Расчет Средневзвешенной дюрации Индекса производится по следующей формуле:

$$D_n = \frac{\sum_{i=1}^N D_{i,n} \left( \frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,n}}{\sum_{i=1}^N \left( \frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,n}}$$

где:

$D_n$  – значение Средневзвешенной дюрации в момент времени  $n$ ;

$D_{i,n}$  – дюрация Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в днях;

$P_{i,n}$  – средневзвешенная цена Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в процентах от номинала;

$FV_{i,n}$  – номинал Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$A_{i,n}$  – накопленный купонный доход Облигации в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$G_{i,n}$  – сумма выплаченного в день  $n$  купонного дохода по Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в рублях;

$N_{i,n}$  – количество ценных бумаг  $i$ -го выпуска Облигаций в Базе расчета момент времени  $n$ .

4.2.2. Расчет Средневзвешенной доходности Индекса осуществляется по следующей формуле:

$$Y_n = \frac{\sum_{i=1}^N Y_{i,n} \left( \frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,n}}{\sum_{i=1}^N \left( \frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,n}}$$

где:

$Y_n$  – значение Средневзвешенной доходности в момент времени  $n$ ;

$Y_{i,n}$  – доходность Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в днях;

$P_{i,n}$  – средневзвешенная цена Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в процентах от номинала;

$FV_{i,n}$  – номинал Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$A_{i,n}$  – накопленный купонный доход Облигации в момент времени  $n$ , выраженный в рублях;

$G_{i,n}$  – сумма выплаченного в день  $n$  купонного дохода по Облигации  $i$ -го выпуска в момент времени  $n$ , выраженная в рублях;

$N_{i,n}$  – количество ценных бумаг  $i$ -го выпуска Облигаций в Базе расчета момент времени  $n$ .

4.3. Расчет значений Индексов, а также Средневзвешенной доходности производится с точностью до двух знаков после запятой. Расчет Средневзвешенной дюрации производится с точностью до целых.

4.4. В случае приостановки (прекращения) торгов выпуском Облигаций, включенных в Базы расчета Индексов, для расчета Индексов в период приостановки торгов выпуском Облигаций (до момента возобновления торгов выпуском Облигаций или до даты исключения выпуска Облигаций из Баз расчета) используется последнее значение средневзвешенной цены выпуска Облигаций.