

Утверждено Приказом
генерального директора
АО УК «Ингосстрах – Инвестиции»
от 08.11.2021 № 04-11/2021

МЕТОДИКА РАСЧЕТА ИНДИКАТОРА «ИНГОССТРАХ ИНДЕКС ИНФЛЯЦИОННЫХ ОФЗ»

1. Общие положения

1.1. Настоящая Методика расчета индикатора «Ингосстрах Индекс Инфляционных ОФЗ» (далее – Методика) определяет порядок расчета индикатора «Ингосстрах Индекс Инфляционных ОФЗ», рассчитываемого ПАО Московская Биржа и публикуемого Акционерным обществом Управляющая компания «Ингосстрах – Инвестиции» (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 раскрывается на официальном сайте Общества в сети Интернет не позднее рабочего дня, следующего за датой утверждения Методики либо изменений и дополнений в Методику, если иное не определено Приказом Генерального директора Общества.

1.4. Наименование индикатора: индикатор «Ингосстрах Индекс Инфляционных ОФЗ» (далее – Индикатор).

2. Общий порядок расчета Индикатора

2.1. Расчет Индикатора осуществляется на основе цен сделок с государственными ценными бумагами Российской Федерации с индексируемым номиналом (номинал определяется с учетом индекса потребительских цен на товары и услуги по РФ, ежемесячно публикуемого Росстатом).

2.2. Правила расчета Индикатора, а также порядок отбора Ценных бумаг определяются в Приложении №1 к настоящей Методике.

2.3. Порядок внесения изменений в Базу расчета и установленные весовые коэффициенты (очередные и внеочередные) определяются в Приложении №1 к настоящей Методике.

2.4. Датой начала расчета Индикатора является дата подписания договора с ПАО Московская биржа. Начальное значение Индикатора установлено равным 100 пунктам.

2.5. 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 14:00 московского времени на официальном сайте Общества в сети Интернет.

3.3.2. Информация о значении Индикатора за весь период расчета, а также иная информация, в том числе раскрытие которой необходимо 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 одного рабочего дня до 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

1. Порядок расчета Индикатора

1.1. Расчет Индикатора, а также дополнительных показателей доходности и дюрации осуществляется каждый торговый день по итогам торгового дня.

1.2. Расчет Индикатора производится ПАО Московская Биржа.

1.3. Данные о Базе расчета Индикатора и значения 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. База расчета Индикатора

2.1 В Базу расчета включаются следующие облигации:

2.1.1. Государственные ценные бумаги Российской Федерации.

2.2 Облигации, включаемые в Базу расчета, должны соответствовать следующим требованиям:

2.2.1 Номинальная стоимость облигаций индексируется в соответствии с индексом потребительских цен Российской Федерации.

2.3 База расчета, состоящая из Ценных бумаг, удовлетворяющих п.п.2.1 – п.2.2 настоящего Приложения, утверждается Инвестиционным комитетом Общества.

2.4. Очередной пересмотр Базы расчета осуществляется Инвестиционным комитетом Общества ежемесячно, за исключением случаев, предусмотренных настоящим Приложением. С даты введения в действие измененной в результате пересмотра Базы расчета на очередной месяц предыдущая База расчета утрачивает силу.

2.5 Внеочередное внесение изменений в Базу расчета осуществляется Инвестиционным комитетом Общества в случае наступления событий, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчеты 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 Очередной пересмотр значений весовых коэффициентов осуществляется Инвестиционным комитетом Общества ежемесячно, одновременно с очередным пересмотром Базы расчета.

3.3 Внеочередной пересмотр значений весовых коэффициентов осуществляется Инвестиционным комитетом Общества в следующих случаях и в следующем порядке:

3.3.1. В случае внеочередного внесения изменений в Базу расчета.

3.3.2. В случае наступления событий, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчет 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 день n ;

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

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

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

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

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

4.2 Расчет Дополнительных показателей осуществляется по следующим формулам:

4.2.1 Расчет Средневзвешенной дюрации Индикатора 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 день n ;

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

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

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

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

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

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

4.2.2 Расчет Средневзвешенной доходности Индикатора 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 день n ;

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

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

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

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

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

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

- 4.3 Расчет значений Индикатора, а также Средневзвешенной доходности производится с точностью до двух знаков после запятой.
- 4.4 Расчет значений дюрации осуществляется в днях.
- 4.5 В случае приостановки (прекращения) торгов выпуском Облигаций, включенных в Базу расчета Индикатора, для расчета Индикатора в период приостановки торгов выпуском Облигаций (до момента возобновления торгов выпуском Облигаций или до даты исключения выпуска Облигаций из Базы расчета) используется последнее значение средневзвешенной цены выпуска Облигаций.