

*Утверждено*

*Индексным комитетом АО «Сбербанк КИБ»*

*Решение от 12.04.2021 № 17*

## **Методика расчета Индекса**

**Сбер Взвешенный Смарт Индекс –  
Sber Weighted Smart Index (SBERSMWT)**

**и правила публикаций значений индекса**

*Версия: 1.00*

*Дата последнего редактирования: 12 апреля 2021 г.*

Настоящая Методика описывает порядок расчёта значений алгоритмической стратегии с объективно определёнными правилами определения таких значений (Индекса) Расчётным агентом по Индексу на протяжении непрерывного периода времени без установления конечной даты и правила публикации таких значений для доступа неограниченного круга лиц.

## 1. Основные положения

### 1.1. Обозначения Индекса:

Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Код Bloomberg
Сбер Взвешенный Смарт Индекс	Sber Weighted Smart Index	SBERSMWT Index

1.2. Страница в сети Интернет, используемая для публикации значений Индекса и настоящей Методики – <https://indices.sberbank-cib.com/?indexId=SBERSMWT>

1.3. Индекс представляет собой показатель изменения цены Динамической Корзины, рассчитываемый на основе информации о ценах и значениях Базовых активов, составляющих Динамическую Корзину.

1.4. Ключевые параметры, используемые для расчёта и идентификации Индекса:

Целевая Волатильность Корзины за период расчета	12%
Период Расчета	125 Дат Оценки
Базовые активы, составляющие Динамическую Корзину	В соответствии с Приложением 1 к настоящей Методике

1.5. Расчет значения Индекса осуществляется однократно за каждый Торговый день по итогам закрытия торговой сессии на Биржах Базового актива.

1.6. Расчетным агентом по Индексу является АО «Сбербанк КИБ».

1.7. Значение Индекса определяется в процентных пунктах и округляется до 2-х десятичных знаков (во избежание сомнений, значению Индекса, равному 100.00%, будет соответствовать опубликованное значение, равное «100.00»).

## 2. Порядок расчёта Индекса:

<b>Определение Индекса</b>	Индекс Цены Динамической Корзины
<b>Дата начала расчёта Индекса (t=0)</b>	01 апреля 2021 г.
<b>Индекс (t)</b>	<p>Значение, определённое для Даты Оценки (t) в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Индекс (t)} = \frac{\text{Цена ДК}_t}{\text{Первоначальное Значение ДК}}, \text{ где}$ <p>Цена ДК<sub>t</sub> – значение Цены Динамической Корзины на соответствующую Дату Оценки (t), в процентах;  <b>Первоначальное Значение ДК</b> – Значение Динамической Корзины в Дату начала расчёта Индекса (t=0), равное 100%.</p>
<b>Цена Динамической Корзины, Цена ДК (t)</b>	<p>Цена Динамической Корзины в любую Дату Оценки (t), рассчитанная в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Цена ДК}_t = \text{Цена ДК}_{t-1} \times \left(1 + \sum_{i=1}^N \text{вес}^i_{t-1} \times \text{Дневная доходность БА}_t^i\right),$ <p>Где:  <b>Цена ДК<sub>0</sub></b> – 100.00%;  <b>Цена ДК<sub>t-1</sub></b> – значение Цены ДК на предшествующую Дату Оценки (t-1);  Дневная доходность БА<sub>t</sub><sup>i</sup> – значение Дневной доходности Базового актива i на Дату Оценки (t);  <b>N</b> – общее количество Базовых активов в Динамической корзине;  вес<sup>i</sup><sub>t-1</sub> – Доля Базового актива i в Динамической корзине на Дату Оценки (t-1).  <b>Дата Оценки (0)</b> – Дата начала расчёта Индекса;</p>

<p><b>Дневная доходность Базового актива i</b></p>	<p>Дневная доходность Базового актива i в любую Дату Оценки (t), рассчитанная следующим образом:</p> <p>1. <u>Для Базовых активов 1-2:</u></p> $\text{Дневная доходность } БА_t^i = \left( \frac{[БА_t^i + ДИВ_t^i] \times FX_t^i}{БА_{t-1}^i \times FX_{t-1}^i} - 1 \right);$ <p>Где:</p> <p>i = 1 или 2;</p> <p><math>БА_t^i</math> – Цена 1 (одного) Базового актива i в Дату Оценки (t);</p> <p><math>БА_{t-1}^i</math> – Цена 1 (одного) Базового актива i в Дату Оценки (t-1);</p> <p><math>ДИВ_t^i</math> – означает, для Базового актива i в Дату Оценки (t) сумму дивидендов, для которых Дата Отсечки на соответствующей Бирже Базового актива i приходится на Торговый день, находящийся в периоде между Датой Оценки, непосредственно предшествующей Дате Оценки (t) (исключая её), до текущей Даты Оценки (t) (включительно), за минусом налога, применимого к доходам, полученным в виде дивидендов от российских и иностранных организаций российскими организациями, а также к доходам в виде дивидендов, полученных по акциям, права на которые удостоверены депозитарными расписками, в том числе удерживаемого у источника выплаты и рассчитанного по ставке, применяемой к дивидендам по Базовому активу i, в случае владения им российской организацией, за минусом комиссий, удержанных депозитариями из дивидендов, полученных по акциям, права на которые удостоверены депозитарными расписками, в том числе удерживаемых у источника выплаты;</p> <p><math>FX_t^i</math> – обменный курс доллара США к рублю РФ, определенный как цена закрытия на торгах долларами США за рубли РФ с расчетами «на завтра» на Московской Бирже в Дату оценки (t) (код инструмента: USD000UTSTOM, источник определения: <a href="https://www.moex.com/ru/marketdata/#/secid=USD000UTSTOM&amp;boardgroupid=13&amp;mode_type=history&amp;mode=instrument">https://www.moex.com/ru/marketdata/#/secid=USD000UTSTOM&amp;boardgroupid=13&amp;mode_type=history&amp;mode=instrument</a>)</p>
--	---

2. Для Базовых активов 3-5:

$$\text{Дневная доходность } \text{БА}_t^i = \left( \frac{\text{БА}_t^i}{\text{БА}_{t-1}^i} - 1 \right)$$

Где:

$i = 3, 4$  или  $5$ ;

$\text{БА}_t^i$  – Значение 1 (одного) Базового актива  $i$  в Дату Оценки ( $t$ );

$\text{БА}_{t-1}^i$  – Значение 1 (одного) Базового актива  $i$  в Дату Оценки ( $t-1$ );

3. Для Базового актива 6:

$$\text{Дневная доходность } \text{БА}_t^6 = \left( \text{Ставка}_{t-1} \times \frac{\text{Факт}_{t,t-1}}{365} \right)$$

Где:

**Факт** $_{t,t-1}$  – количество календарных дней, считая с Даты Оценки, непосредственно предшествующей Дате Оценки ( $t$ ), включительно, до текущей Даты Оценки ( $t$ ), исключая её.

**Ставка** $_{t-1}$  – значение индикативной взвешенной ставки однодневных рублевых кредитов (депозитов) в рублях на московском межбанковском рынке, рассчитываемой Банком России по методике, разработанной Национальной валютной ассоциацией совместно с Банком России, и опубликованное около 17:00 по московскому времени на странице RUONIA= в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <http://www.ruonia.ru> (далее – «ставка RUONIA») в дату, непосредственно предшествующую Дате Оценки ( $t$ ), либо значение иной ставки, определённой в соответствии с правилами, изложенными в разделе «Событие прекращения расчёта Ставки».

<b>Базовые активы, составляющие Динамическую Корзину</b>	<p>В соответствии с Приложением 1 к настоящей Методике</p>
<b>Доля Базового актива i в Динамической корзине</b>	<p>1. На все Даты Оценки (t), не являющиеся Датой ребалансировки, Доля Базового актива i в Динамической корзине устанавливается в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Вес}_t^i = \text{Вес}_{t-1}^i \times \frac{1 + \text{Дневная доходность БА}_t^i}{1 + \text{Изменение цены ДК}_t}$ <p>Где:</p> <p>Изменение цены ДК<sub>t</sub> = <math>\left( \frac{\text{Цена ДК}_t}{\text{Цена ДК}_{t-1}} - 1 \right)</math>;</p> <p>Вес<sub>t-1</sub><sup>i</sup> – Доля Базового актива i в Динамической Корзине на предшествующую Дату Оценки (t-1);</p> <p>2. На все Даты ребалансировки Доля Базового актива i в Динамической корзине устанавливается равной Скорректированному Оптимальному Весу Базового актива i.</p> <p>Во избежание сомнений, на Дату Оценки (0), которая является одновременно Датой начала расчёта Индекса и Датой ребалансировки, Доля Базового актива i в Динамической корзине устанавливается равной Начальной Доле Базового актива i в Динамической корзине в соответствии с Приложением 1;</p>

<b>Скорректированный Оптимальный Вес Базового актива <math>i</math></b>	<p>На каждую Дату ребалансировки Скорректированный Оптимальный Вес Базового актива <math>i</math> устанавливается следующим образом:</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1. <u>Для каждого из Базовых активов 1-5:</u> равным Оптимальному Весу Базового актива <math>i</math>, определенному на наиболее позднюю Дату определения Оптимального Веса Базового актива <math>i</math>, выраженному в процентных пунктах и округлённому вниз до целого значения. <i>(во избежание сомнений, значению Оптимального Веса Базового актива <math>i</math>, равному 55.55%, будет соответствовать значение Скорректированного Оптимального Веса Базового актива <math>i</math>, равное «55.00%»)</i></li><li>2. <u>Для Базового актива 6:</u> равным разнице 100% и суммы Скорректированных Оптимальных Весов Базового актива <math>i</math> для Базовых активов 1-5</li></ol>
---	--

<p><b>Оптимальный Вес Базового актива i</b></p>	<p>На каждую Дату определения Оптимального Веса Базового актива i Оптимальный Вес Базового актива i устанавливается путем нахождения таких Долей Базового актива i в Динамической корзине, при которых Доходность Корзины за Период Расчета, непосредственно предшествующий такой дате, является максимальной при одновременном соблюдении следующих ограничений:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Сумма всех Долей Базовых активов i в Динамической Корзине равняется 1;</li> <li>2. Для каждого Базового актива i:             <ol style="list-style-type: none"> <li>2.1. Доля Базового актива i в Динамической Корзине составляет не менее Минимальной Доли Базового актива i в Динамической Корзине;</li> <li>2.2. Доля Базового актива i в Динамической Корзине не превышает Максимальной Доли Базового актива i в Динамической Корзине;</li> <li>2.3. Сумма Долей Базовых активов i в Динамической Корзине для Базовых активов 1 и 3 не превышает 40%;</li> </ol> </li> <li>3. Волатильность Корзины за Период Расчета не превышает значение Целевой Волатильности Корзины за Период Расчета.</li> </ol>
<p><b>Дата определения Оптимального Веса Базового актива i</b></p>	<p>25-е число в третьем месяце каждого календарного квартала. Если такая дата не является Датой Оценки (t), то первая по счету предшествующая Дата Оценки (t)</p>
<p><b>Дата ребалансировки</b></p>	<p>Первая Дата Оценки в первом месяце каждого календарного квартала</p>



<p><b>Доходность Корзины за Период Расчета</b></p>	<p>В любую Дату Оценки (t), являющейся одновременно Датой определения Оптимального Веса Базового актива i, Доходность Корзины за Период Расчёта, непосредственно предшествующий такой Дате оценки (t), определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $r_t^{\text{Корзина}} = \sum_{i=1}^N (w^i \times r_t^i),$ <p>Где:  <math>r_t^{\text{Корзина}}</math> – значение Доходности Корзины за Период расчёта в Дату Оценки (t);  <math>w^i</math> – значение Оптимальных Весов Базовых активов i  <math>r_t^i</math> – значение Среднедневной Доходности Базового Актива i за Период Расчета в Дату Оценки (t);  <b>N</b> – общее количество Базовых активов i в Динамической корзине;</p>
<p><b>Среднедневная Доходность Базового Актива i за Период Расчета</b></p>	<p>В любую Дату Оценки (t) Среднедневная Доходность Базового Актива i за Период Расчета, непосредственно предшествующий такой Дате оценки (t), определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $r_t^i = \frac{1}{k} \times \sum_{j=t-k+1}^t \ln(1 + \text{Дневная доходность БА}_j^i)$ <p>Где:  <math>r_t^i</math> – значение Среднедневной Доходности Базового Актива i за Период Расчета в Дату Оценки (t);  <b>ln</b> – натуральный логарифм;  <b>k</b> – количество Дат Оценки в течение Периода Расчёта;</p>

<p><b>Волатильность Корзины за Период Расчета</b></p>	<p>В любую Дату Оценки (t) Волатильность Корзины за Период Расчета, непосредственно предшествующий такой Дате оценки (t), определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $\sigma_t^{\text{Корзина}} = \sqrt{252} \times \sqrt{\sum_{i=1}^N \sum_{j=1}^N w^i \times cov_{t,k}^{i,j} \times w^j}$ <p>Где:</p> <p><b>252</b> – фактор аннуализации для целей расчета реализованной волатильности и представляет собой ожидаемое количество Торговых дней в каждом календарном году;</p> <p><math>cov_{t,k}^{i,j}</math> – значение Ковариации Базового Актива i и Базового Актива j за Период Расчета в Дату Оценки (t);</p>
<p><b>Ковариация Базового Актива i и Базового Актива j за Период Расчета</b></p>	<p>В любую Дату Оценки (t) Ковариация Базового Актива i и Базового Актива j за Период Расчета, непосредственно предшествующий такой Дате оценки (t), определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $cov_{t,k}^{i,j} = \frac{1}{k-1} \times \sum_{s=t-k+1}^t (\ln(1 + \text{Дневная доходность } БА_s^i) - r_t^i) \times (\ln(1 + \text{Дневная доходность } БА_s^j) - r_t^j)$ <p>Где</p> <p><math>r_t^i</math> – значение Среднедневной Доходности Базового Актива i за Период Расчета для Базового актива с порядковым номером i в Дату Оценки (t);</p> <p><math>r_t^j</math> – значение Среднедневной Доходности Базового Актива j за Период Расчета для Базового актива с порядковым номером j в Дату Оценки (t);</p>
<p><b>Целевая Волатильность Корзины за Период Расчета</b></p>	<p>12%</p>

<b>Период Расчета</b>	125 Дат Оценки
<b>Событие прекращения расчёта Ставки</b>	Значение ставки RUONIA не может быть определено, отсутствует на указанной странице в системе Reuters и/или в Интернет на официальном сайте Банка России и/или на странице <a href="http://www.ruonia.ru">http://www.ruonia.ru</a> , прекратит рассчитываться, либо администратором ставки RUONIA опубликовано заявление о том, что ставка RUONIA более не считается репрезентативной для целей определения безрисковой стоимости денег в рублях.
<b>Восполнительные процедуры при наступлении События прекращения расчёта Ставки</b>	При наступлении События прекращения расчёта Ставки, в качестве Ставки <sub>t-1</sub> Расчетный агент по Индексу, действуя в коммерчески разумной манере, выберет или рассчитает другую ставку, которую будут широко использовать рыночные участники для перехода от ставки RUONIA к значению ставки, отражающей стоимость однодневных кредитов (депозитов) в рублях для независимых рыночных контрагентов, где заёмщику присвоен (явно или очевидно) наименьший возможный кредитный риск.

<p><b>Событие делистинга Базового актива, являющегося ценной бумагой</b></p>	<p>Событием делистинга Базового актива, являющегося ценной бумагой, считается:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Биржей Базового актива принято решение об исключении Базового актива из перечня инструментов, по которым проводятся торги. Датой События делистинга Базового актива по основанию, указанному в настоящем пункте, признаётся последний торговый день, в который проводятся торги по Базовому активу на соответствующей Бирже Базового актива;</li> <li>2. Событие нарушения источника цены Базового актива, продолжающееся в течение более 6 последовательных Торговых дней. Датой События делистинга Базового актива по основанию, указанному в настоящем пункте, признаётся последний торговый день, в который Биржей Базового актива была опубликована (раскрыта) рыночная цена Базового актива (либо – в случае, если Биржей Базового актива не публикуется (не раскрывается) рыночная цена Базового актива – цена закрытия Базового актива).</li> </ol>
<p><b>Восполнительные процедуры при наступлении События делистинга Базового актива, являющегося ценной бумагой</b></p>	<p>В случае наступления События делистинга Базового актива, являющегося ценной бумагой, Расчётный агент по Индексу может заменить Базовый актив («Заменяемый Базовый актив») на иной Базовый актив («Заменяющий Базовый актив»), соответствующий следующим критериям:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Заменяющий Базовый актив является ценной бумагой, допущенной к обращению (прошедшей листинг) на бирже;</li> <li>2. Целью инвестиционной политики управляющей компании Заменяющего Базового актива является обеспечение соответствия изменений расчетной цены Заменяющего Базового актива изменениям тех же количественных показателей, что и для Заменяемого Базового актива;</li> <li>3. При наличии более чем одного Базового актива, удовлетворяющего критерию пп. 1. и 2. настоящего раздела, в качестве Заменяющего Базового актива будет выбран Базовый актив, имеющий бóльший среднедневной объём торгов по сравнению с другими Базовыми активами, удовлетворяющими критериям пп. 1. и 2., на наиболее позднюю дату, предшествующую дате принятия решения о замене Базового актива, при условии, что такой</li> </ol>

	<p>Заменяемый Базовый актив уже не является Базовым активом, составляющим Динамическую Корзину;</p> <p>4. Заменяющий Базовый Актив включается в расчет Индекса с сохранением Доли Базового актива <math>i</math> в Динамической Корзине на таком же уровне, как у Заменяемого Базового актива на наиболее позднюю дату, предшествующую дате принятия решения о замене Базового актива.</p>
<p><b>Событие нарушения Базового актива, являющегося индексом</b></p>	<p>Событием нарушения Базового актива, являющегося индексом, считается:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Биржей Базового актива было опубликовано уведомление о прекращении расчёта Базового актива, являющегося индексом, или</li> <li>2. Имеется общедоступная (как определено Расчётным агентом по Индексу) информация о будущем прекращении существования (расчёта) Базового актива, являющегося индексом, или</li> <li>3. Событие нарушения источника цены Базового актива, продолжающееся в течение более 6 последовательных Торговых дней. Датой События делистинга Базового актива по основанию, указанному в настоящем пункте, признаётся последний торговый день, в который Биржей Базового актива была опубликована (раскрыта) Цена Базового актива <math>i</math>, или</li> <li>4. Биржей Базового актива было опубликовано уведомление об изменении методики расчёта Базового актива, являющегося индексом, которое, после вступления такого изменения в силу, не позволяет, по обоснованному мнению Расчётного агента по Индексу, использовать значения для определения значений веса <math>a_t^i</math> для целей расчёта значений Индекса.</li> </ol> <p>Дата, в которую определено наступление одного или нескольких событий, указанных в пп. 1.-4. настоящего раздела, является «Датой определения События нарушения Базового актива, являющегося индексом»</p>

<p><b>Восполнительные процедуры при наступлении События делистинга Базового актива, являющегося индексом</b></p>	<p>В случае наступления События делистинга Базового актива, являющегося индексом, Расчётный агент по Индексу может заменить Базовый актив («Заменяемый Базовый актив») на иной Базовый актив («Заменяющий Базовый актив»), соответствующий следующим критериям:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Заменяющий Базовый актив является индексом;</li> <li>2. Целью лица, осуществляющего расчёт и публикацию значений Заменяющего Базового актива, является обеспечение соответствия изменений значений Заменяющего Базового актива изменениям тех же количественных показателей, что и для Заменяемого Базового актива;</li> <li>3. При наличии более чем одного Базового актива, удовлетворяющего критерию пп. 1. и 2. настоящего раздела, в качестве Заменяющего Базового актива будет выбран Базовый актив, имеющий бóльший среднедневной объём торгов по сравнению с другими Базовыми активами, удовлетворяющими критериям пп. 1. и 2., на наиболее позднюю дату, предшествующую дате принятия решения о замене Базового актива, при условии, что такой Заменяемый Базовый актив уже не является Базовым активом, составляющим Динамическую Корзину;</li> <li>4. Заменяющий Базовый Актив включается в расчёт Индекса с сохранением Доли Базового актива <math>i</math> в Динамической Корзине на таком же уровне, как у Заменяемого Базового актива на наиболее позднюю дату, предшествующую дате принятия решения о замене Базового актива.</li> </ol>
<p><b>Событие нарушения источника цены Базового актива</b></p>	<p>Событие и/или обстоятельство, в результате которого становится невозможным получить цену любого из Базовых активов, являющегося ценной бумагой, либо значение любого из Базовых активов, являющегося индексом, в дату, в которую цена такого Базового актива должна быть опубликована (раскрыта).</p>
<p><b>Восполнительные процедуры при наступлении События</b></p>	<p>В случае наступления События нарушения источника цены Базового актива для одного или нескольких Базовых активов, продолжающегося в течение не более 6 последовательных Торговых дней, в качестве значения <math>BA_t^i</math> для такого актива</p>

<p><b>нарушения источника цены Базового актива</b></p>	<p>или активов в целях расчёта значения Цена Динамической Корзины в такую Дату Оценки (t) используется значение <math>BA_{last\_t}^i</math>, где “last_t” – наиболее поздняя дата, в которую было опубликована цена Базового актива i, являющегося ценной бумагой, либо значение Базового актива i, являющегося индексом.</p> <p>Во избежание сомнений, значение “last_t” для различных Базовых активов может быть также различным.</p>
<p><b>Дата Оценки (t)</b></p>	<p>Каждый Торговый день, начиная с Даты начала расчёта Индекса</p>
<p><b>Торговый день</b></p>	<p>Каждый день, когда проводятся торги на Московской Бирже</p>
<p><b>Рабочий день</b></p>	<p>День, не являющийся выходным или праздничным в Российской Федерации</p>
<p><b>Дата Отсечки</b></p>	<p>Торговый день, начиная с которого покупка Базового актива i на соответствующей Бирже Базового актива i не дает права на получение суммы ранее объявленных дивидендов. Во избежание сомнений, последним Торговым днем, в который покупка Базового актива i дает право на получение суммы ранее объявленных дивидендов, является Торговый день, непосредственно предшествующий Дате Отсечки.</p>

### 3. Контроль за расчетом Индекса

- 3.1. Значения Индекса, рассчитанные Расчетным агентом по Индексу, считаются окончательными в отсутствие явных арифметических или других очевидных ошибок, а также в отсутствие технического сбоя при расчёте Индекса.
- 3.2. В случае возникновения технического сбоя при расчете Индекса либо технического сбоя в ходе торгов ценными бумагами на Бирже Базовых активов, приведшего к искажению данных, использовавшихся для расчета Индекса, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений Индекса с соответствующим на то указанием Расчетным агентом по Индексу на своем официальном сайте в сети Интернет. Указанный перерасчет осуществляется в минимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя.
- 3.3. Любые изменения используемых в расчете Индекса показателей утверждаются Решением Индексного комитета АО «Сбербанк КИБ». При этом Расчётный агент по Индексу раскрывает на своём официальном сайте в сети Интернет:

- информацию об обстоятельствах, учтенных при изменении указанных показателей;
- для показателей, основанных на субъективной (экспертной) оценке - обоснование таких изменений

не позднее дня, следующего за днем вступления в силу таких изменений.

3.4. В случае принятия решения Расчетным агентом по Индексу приостановить расчет Индекса по любым причинам, не зависящим от обстоятельств непреодолимой силы, Расчетный агент по индексу раскроет информацию об этом на своем официальном сайте в сети Интернет не позднее, чем за 3 месяца до даты окончания расчетов.

#### **4. Публикация информации**

- 4.1. Публикация информации об Индексе, в том числе информации о значении Индекса на каждую Дату Оценки, осуществляется Расчетным агентом по Индексу через его представительство в сети Интернет на странице <http://indices.sberbank-cib.com>.
- 4.2. Информация, подлежащая в соответствии с настоящей Методикой публикации в сети Интернет, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства.
- 4.3. Публикация информации о значении Индекса на каждую Дату Оценки осуществляется не позднее следующего, после соответствующей Даты Оценки, Рабочего дня.



## Приложение 1 к Методике расчета Индекса

	Класс Базового актива i	Наименование Базового актива i	Код Bloomberg / ISIN <sup>1</sup>	1. Биржа Базового актива i 2. Источник определения Цены/Значения Базового актива i <sup>2</sup>	Начальная Доля Базового актива i в Динамической Корзине	Минимальная Доля Базового актива i в Динамической Корзине	Максимальная Доля Базового актива i в Динамической Корзине
1	Ценная бумага	SPDR S&P 500 ETF TRUST SPY	SPY UP Equity / US78462F1030	1. Нью-Йоркская фондовая биржа (NYSE) 2. <a href="https://www.nyse.com/quote/ARCX:SPY">https://www.nyse.com/quote/ARCX:SPY</a> (значение "Close")	0%	0%	40%
2	Ценная бумага	SPDR GOLD SHARES	GLD UP Equity / US78463V1070	1. Нью-Йоркская фондовая биржа (NYSE) 2. <a href="https://www.nyse.com/quote/ARCX:GLD">https://www.nyse.com/quote/ARCX:GLD</a> (значение "Close")	0%	0%	70%
3	Индекс	Индекс МосБиржи полной доходности "брутто"	MCFTR Index / RU000A0JWY86	1. Московская биржа 2. <a href="https://www.moex.com/ru/index/MCFTR/archive">https://www.moex.com/ru/index/MCFTR/archive</a> (значение "Закрытие")	40%	0%	40%
4	Индекс	Индекс корпоративных облигаций 1-3	RUCBTR3Y Index / RU000A0JPSZ2	1. Московская биржа 2. <a href="https://www.moex.com/ru/index/RUCBTR3Y/archive">https://www.moex.com/ru/index/RUCBTR3Y/archive</a> (значение "Закрытие")	30%	0%	100%
5	Индекс	Индекс МосБиржи государственных облигаций	RGBITR Index / RU000A0JQV87	1. Московская биржа 2. <a href="https://www.moex.com/ru/index/RGBITR/archive">https://www.moex.com/ru/index/RGBITR/archive</a> (значение "Закрытие")	0%	0%	100%
6	Валюта	Инструменты Денежного рынка <sup>3</sup>	Не применимо	1. Не применимо 2. Не применимо	30%	0%	30%

<sup>1</sup> Источник определения Цены Базового актива i и коды ISIN для Базового актива i актуальны по состоянию на дату утверждения настоящей Методики Индексным комитетом АО «Сбербанк КИБ» (Решение от 12.04.2021 № 17).

<sup>2</sup> Или иная страница в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», используемая Биржей Базового актива i для публикации информации о ценах закрытия.

<sup>3</sup> Означает денежные средства, размещенные в инструменты денежного рынка, приносящие доходность согласно разделу «Дневная доходность Базового актива i»