

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ООО УК «Альфа-Капитал»
№ 45/23 от «24» апреля 2023 г.

Методика расчета индикатора
«Индекс Альфа-Капитал Космос Рублевый»

Москва, 2023

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ВВЕДЕНИЕ	3
1.1. Термины и определения	3
1.2. Общие положения	3
2. РАСЧЕТ ИНДИКАТОРОВ.....	3
2.1. Порядок расчета Индикатора	3
2.2. Определение цены ценной бумаги	4
3. ФОРМИРОВАНИЕ И ПЕРЕСМОТР БАЗЫ РАСЧЕТА	4
3.1. Принципы формирования Базы расчета	4
3.2. Порядок пересмотра баз расчета	4
3.3. Учет корпоративных событий	5
4. РЕГЛАМЕНТ РАСЧЕТА И РАСКРЫТИЯ ИНФОРМАЦИИ ОБ ИНДИКАТОРАХ.....	5
4.1. Расписание расчета	5
4.2. Контроль за расчетом индикаторов	5
4.3. Раскрытие информации	6

1. Введение

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. В целях настоящей Методики расчета индикатора «Индекс Альфа-Капитал Космос Рублевый» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:
- Акции – акции Эмитентов, допущенные к обращению на организованных торгах ПАО Московская Биржа, европейских и американских бирж.
 - База расчета - список ценных бумаг и количество каждой бумаги для расчета индикатора.
 - Биржа, ПАО Московская Биржа - Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
 - Индикатор – показатель, рассчитываемый на основании сделок с ценными бумагами, входящими в Базу расчета.
 - Удельный вес Акции - доля стоимости Акции в суммарной стоимости всех Акции в Базе расчета, выраженная в процентах.
 - Эмитент - эмитент обыкновенных, привилегированных или представляемых акций.

1.2. Общие положения

- 1.2.1. Наименования и коды Индикаторов:

Код индекса	Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Тип индекса
AKSPRU	Индекс Альфа Капитал Космос Рублевый	Alfa Capital Space Index RUB	Ценовой индекс

- 1.2.2. Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется по согласованию с Биржей (калькулирующий агент).

2. Расчет индикаторов

2.1. Порядок расчета Индикатора

- 2.1.1. Капитализация i -той Акции в индексе в день t , рассчитывается по формуле:

$$IC_{t,i} = P_{t,i} \cdot Q_{t,i}$$

$P_{t,i}$ – цена i -той Акции в момент расчета t , выраженная в рублях;

$Q_{t,i}$ – количество i -тых Акции одной категории (типа) одного эмитента, согласно базе расчета индекса на момент t .

- 2.1.2. Капитализация индекса рассчитывается как суммарная стоимость акций согласно базе расчета индекса

$$IC_t = \sum_{i=1}^N IC_{t,i}$$

N – Общее число Акции в индексе;

- 2.1.3. Значения капитализации $IC_{t,i}$, рассчитывается с точностью до четырех знаков после запятой.

- 2.1.4. Делитель – корректирующий показатель капитализации индекса, отражающий изменение его состава и корпоративные действия, рассчитываемый по формуле:

$$D_t = D_{t-1} \frac{\sum_{i=1}^{N_t} (P_{t-1,i} Q_{t,i})}{\sum_{j=1}^{N_{t-1}} (\bar{P}_{t-1,j} \bar{Q}_{t-1,j})}$$

N_{t-1} и N_t – число Акции в индексе ДО и ПОСЛЕ изменения его состава или корпоративных действий

$P_{t-1,i}$ и $Q_{t,i}$ – цена и количество i -тых Акции в индексе ПОСЛЕ изменения его состава или корпоративных действий

$\bar{P}_{t-1,j}$ и $\bar{Q}_{t-1,j}$ – цена и количество j -тых Акции в индексе ДО изменения его состава или корпоративных действий.

Если база расчета индекса не меняется, и нет корпоративных событий, то $P = \bar{P}$,

$Q = \bar{Q}$, соответственно, $D_t = D_{t-1}$

В первый день расчета Индекса Делитель рассчитывается по формуле:

$$D_1 = \frac{IC_1}{I_1}$$

- 2.1.5. Расчет Делителя D_t осуществляется с точностью до четырех знаков после запятой по правилу математического округления.
- 2.1.6. Значение ценового Индекса в момент расчета t рассчитывается как

$$I_t = \frac{IC_t}{D_t},$$

где:

I_t – значение Индекса в момент расчета t ;

IC_t – капитализация Индекса на момент расчета t .

- 2.1.7. Значения Индекса выражаются в пунктах и рассчитываются с точностью до двух знаков после запятой.
- 2.1.8. Значение Индекса по состоянию на дату первого произведенного расчета: $I_1 = 100$ пунктов на 09 марта 2023 г.

2.2. Определение цены ценной бумаги

- 2.2.1. Для определения цены i -ой ценной бумаги (P_i) используются цены сделок, совершаемых на торгах на биржах обращения соответствующих бумаг.
- 2.2.2. Цена i -ой ценной бумаги (P_i) устанавливается равной цене последней сделки и переводится в рубли в соответствии с Методикой расчета индикативных валютных курсов.

3. Формирование и пересмотр Базы расчета

3.1. Принципы формирования Базы расчета

- 3.1.1. База расчета Индекса формируется из акций компаний, эмитенты которых осуществляют деятельность прямо или косвенно в космической сфере и смежных отраслях, которые могут быть включены в портфель БПИФ согласно действующим правилам и законодательным ограничениям. Список ценных бумаг утверждается инвестиционным комитетом департамента управления активами УК «Альфа Капитал» и предварительно согласовывается с Биржей на предмет технической возможности их использования для расчета индекса и iNAV БПИФ.
- 3.1.2. Датой формирования Базы расчета является следующий торговый день за датой принятия соответствующего решения инвестиционным комитетом департамента управления активами УК «Альфа Капитал»
- 3.1.3. База расчета содержит наименования ценных бумаг, указания на категорию (тип) ценных бумаг, количество бумаг в индексе

3.2. Порядок пересмотра баз расчета

- 3.2.1. Включение ценных бумаг в Базу расчета, исключение ценных бумаг и изменение их количества в Базе расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета.
- 3.2.2. Регулярный пересмотр Базы расчета производится не позднее чем за 5 рабочих дней до окончания квартала, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Пересмотренная База расчета вступает в силу в первый торговый день нового квартала. Могут быть установлены иные даты вступления в силу пересмотренной Базы расчета.
- 3.2.3. Количество каждой Акции в пересмотренной Базе расчета рассчитывается как:

$$Q_i = \frac{IC_t}{N_{new} * P_{t,i}},$$

Где IC_t – капитализация индекса на день пересмотра базы расчета (рассчитанная на основе действующей базы расчета индекса)

$P_{t,i}$ – цена i -той акции из пересмотренной Базы расчета на день пересмотра.

N_{new} – число акций в новой Базе расчета

Q_i - количество i -тых Акций в новой Базе расчета.

- 3.2.4. Внеочередной пересмотр Баз расчета может быть осуществлен в случае возникновения следующих событий:
- Прекращении торговли ценными бумагами из базы расчета индексов на организованных торгах;
 - В связи с введением ограничения возможности совершения сделок с ценными бумагами;
 - 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 иных случаях, которые могут оказать существенное влияние на расчет Индекса.

3.3. Учет корпоративных событий

- 3.3.1. В случае изменения объема и/или порядка осуществления прав, закрепленных представляемыми акциями в соответствии с иностранным правом, решение об учете данных событий принимается на основании субъективной (экспертной) оценки.
- 3.3.2. В случае приостановки торгов i -ой акцией на срок более одного торгового дня цена, используемая для расчета, остается равной последней рассчитанной перед приостановкой торгов цене.
- 3.3.3. В случае дробления или консолидации i -ых акций в дату допуска к торгам выпуска акций, в которые осуществлена конвертация акций в связи с их дроблением или консолидацией, осуществляется пересчет общего количества i -ых акций (Q_i), а также цены i -той акции (P_i), рассчитанной по итогам торгового дня, предшествующего указанной дате. В ходе такого пересчета общее количество i -ых акций (Q_i) умножается на коэффициент дробления или делится на коэффициент консолидации, а цена i -той акции (P_i) делится на коэффициент дробления или умножается на коэффициент консолидации.
- 3.3.4. При реорганизации акционерного общества цена акций этого акционерного общества фиксируется на уровне, определенном по итогам торгового дня, предшествующего дате фиксации. В зависимости от результатов реорганизации при прекращении фиксации цены i -ой акции может осуществляться корректировка цены и/или иных параметров i -ой акции. Дата фиксации параметров, а также условия прекращения фиксации определяются на основании субъективной (экспертной) оценки.

4. Регламент расчета и раскрытия информации об индексах

4.1. Расписание расчета

- 4.1.1. Расчет значений ценового Индекса осуществляется с 10:15 до 19:00 в рабочие дни Биржи с периодичностью 1 раз в 15 минут
- 4.1.2. Указанная периодичность расчета Индексов может быть изменена решением ООО «Управляющая компания «Альфа-Капитал» по согласованию с Биржей с раскрытием информации за 3 дня до вступления в силу данного решения.

4.2. Контроль за расчетом индексов

- 4.2.1. В случае возникновения технического сбоя при расчете Индексов, либо технического сбоя в ходе получения ценовой информации, необходимой для их расчета, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений. Указанный перерасчет осуществляется в минимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя.
- 4.2.2. В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексами реального состояния финансового рынка, калькулирующий агент при обязательном уведомлении ООО «Управляющая компания «Альфа-Капитал» вправе предпринять любые действия, необходимые для обеспечения адекватности Индексов, в том числе исключить ценные бумаги из Базы расчета Индексов, включить ценные бумаги в Базы расчета, установить значения параметров, используемых для расчета показателей, предусмотренных настоящей Методикой и т.д.

4.3. Раскрытие информации

- 4.3.1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой, осуществляется в сети Интернет на странице www.alfacapital.ru.
- 4.3.2. Значения Индексов за предыдущий торговый день раскрываются не позднее 12:00 московского времени.
- 4.3.3. Информация, раскрываемая в соответствии с настоящей Методикой, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах ценными бумагами