

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ООО УК «Альфа-Капитал»
№ 15/24 от «17» января 2024 г.

**Методика расчета индикатора «Альфа-Капитал Умный
портфель»**

Москва, 2024

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ВВЕДЕНИЕ	3
1.1. Термины и определения	3
1.2. Общие положения	3
2. РАСЧЕТ ИНДИКАТОРА.....	3
2.1. Используемые данные	3
2.2. Порядок расчета.....	3
3. РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ	3

1. Введение

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. В целях настоящей Методики расчета индикатора «Альфа-Капитал Умный портфель» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:
- БПИФы – Паи биржевых фондов, допущенные к обращению на организованных торгах ПАО Московская Биржа
 - Ценная бумага – акция или пай БПИФ.

1.2. Общие положения

- 1.2.1. Наименования и коды Индикаторов:

Код индикатора	Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Тип индикатора
IAKSM	Альфа Капитал Умный портфель	Alfa Capital Index	Полной доходности

- 1.2.2. Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется по инициативе Департамента управления активами

2. Расчет индикатора

2.1. Используемые данные

- 2.1.1. Для расчета значения индикатора используется стоимость пая (iNAV) на закрытие торгов, следующих БПИФ, находящихся под управлением УК «Альфа-Капитал»
- Альфа-Капитал Управляемые российские акции (далее АКМЕ)
 - Альфа-Капитал Управляемые облигации (далее АКМВ)
 - Альфа-Капитал Денежный рынок (далее АКММ)
 - Альфа-Капитал Золото (далее АКГД)
- 2.1.2. АКМЕ(t), АКМВ(t), АКММ(t), АКГД(t) здесь и далее отражают расчетную стоимость пая на день t

2.2. Порядок расчета

- 2.2.1. Начальное значение IAKSM (0) устанавливается равным 100 на дату 01.01.2022
- 2.2.2. Значение индикатора на дату t, начиная с t=1 рассчитывается как:

$$IAKSM(t) = 0,5 \frac{AKME_t}{AKME_{t-1}} + 0,2 \frac{AKMB_t}{AKMB_{t-1}} + 0,2 \frac{AKMM_t}{AKMM_{t-1}} + 0,1 \frac{AKGD_t}{AKGD_{t-1}}$$

- 2.2.3. Каждое последующее значение индикатора рассчитывается на каждую дату, на которую осуществляется расчет стоимости пая всех фондов, используемых в расчете индикатора.
- 2.2.4. Если на календарную дату расчет значения индикатора не возможен, его значение устанавливается равным последнему рассчитанному значению.

3. Раскрытие информации

- 3.1.1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой, осуществляется в сети Интернет на странице www.alfacapital.ru.