

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ООО УК «Альфа-Капитал»
№271/24 от «17» декабря 2024 г.

**Методика расчета индикатора «Альфа-Капитал Платина-
Палладий»**

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 Платина-Палладий» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:
- Платина – пара платина/российский рубль с расчетом на следующий после заключения сделки рабочий день (PLTRUB_TOM), торгуемая на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов Московской биржи
 - Палладий – пара палладий/российский рубль с расчетом на следующий после заключения сделки рабочий день (PLDRUB_TOM), торгуемая на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов Московской биржи

1.2. Общие положения

- 1.2.1. Наименования и коды Индикаторов:

Код индикатора	Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Тип индикатора
IAKPP	Альфа Капитал Платина-Палладий	Alfa Capital Platinum-palladium 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 цена платины и палладия на закрытие торгов

2.2. Порядок расчета

- 2.2.1. Начальное значение IAKPP (0) устанавливается равным 100 на дату 01.11.2024
2.2.2. Значение индикатора на дату t , начиная с $t=1$ рассчитывается как:

$$IAKPP(t) = 0,5 \frac{PLTRUB_TOM_t}{PLTRUB_TOM_{t-1}} + 0,5 \frac{PLDRUB_TOM_t}{PLDRUB_TOM_{t-1}}$$

- 2.2.3. Каждое последующее значение индикатора рассчитывается на каждую дату, в которую проводились торги всеми инструментами, используемыми в расчете индикатора.
2.2.4. Если на календарную дату расчет значения индикатора невозможен, 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.