

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ООО УК «Альфа-Капитал»
№ 79-а/25 от «04» июня 2025 г.

**Методика расчета индикатора «Альфа-Капитал Смешанный
Бенчмарк»**

Москва, 2025

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 Смешанный Бенчмарк» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:

- Московская Биржа – ПАО Московская Биржа
- Индекс 1 – Индекс МосБиржи Корпоративных Облигаций (код индекса RUCBTAAAANS), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/RUCBTAAAANS>
- Индекс 2 – Индекс МосБиржи полной доходности «брутто» (код индекса MCFTR), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/totalreturn/MCFTR>

1.2. Общие положения

1.2.1. Наименования и коды Индикаторов:

Код индикатора	Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Тип индикатора
IAKMB	Альфа Капитал Смешанный Бенчмарк	Alfa Capital Mixed Benchmark Index	Полной доходности

1.2.2. Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется по инициативе Стратегического управления ООО УК «Альфа-Капитал».

2. Расчет индикатора

2.1. Используемые данные

Для расчета значения индикатора используются значения Индекса 1 и Индекса 2

2.2. Порядок расчета

2.2.1. Значение индикатора на дату t , начиная с $t=1$ рассчитывается как:

$$IAKMB(t) = 0,6 * RUCBTAAAANS_t + 0,4 * MCFTR_t$$

2.2.2. Каждое последующее значение индикатора рассчитывается на каждую дату, в которую Московской Биржей проводился расчет Индексов 1 и 2, используемых в расчете индикатора.

2.2.3. 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.