

**УТВЕРЖДЕНА**  
**Приказом Генерального директора**  
**ООО УК «Альфа-Капитал»**  
**№ 145/25 от «14» октября 2025 г.**

**Методика расчета индикатора «Альфа-Капитал Равновесный  
индекс»**

**Москва, 2025**

## ОГЛАВЛЕНИЕ

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

## 1. Введение

### 1.1. Термины и определения

1.1.1. В целях настоящей Методики расчета индикатора «Альфа-Капитал Равновесный индекс» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:

Московская Биржа – ПАО Московская Биржа

Индекс 1 – Индекс МосБиржи государственных облигаций (код индекса RGBITR), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/RGBITR>

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
IAKEQ	Альфа Капитал Равновесный индекс	Alfa Capital Equilibrium 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:

$$IAKEQ(t) = 0,5 * RGBITR_t + 0,5 * MCFTR_t$$

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.

2.2.4. Расчет индикатора начинается с даты расчета первой СЧА по Открытому паевому инвестиционному фонду рыночных финансовых инструментов «Сбалансированные Возможности»

## 3. Раскрытие информации

3.1.1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой, осуществляется в сети Интернет на странице [www.alfacapital.ru](http://www.alfacapital.ru).