

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

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 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/RGBTIR>
 - ~ **Индекс 2** – Индекс МосБиржи полной доходности «брутто» (код индекса MCFTTR), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/totalreturn/MCFTTR>

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:

$$IAKEQ(t) = 0,5 * RGBITRt + 0,5 * MCFTTRt$$

- 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 Открытыму 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.