

Утверждено Протоколом
Комитета по индикаторам
финансовых рынков АО «Тинькофф Банк»
от 01.09.2023 № 01-09/2023

Методика расчета «TINKOFF GOLDINDEX» Редакция 2

Москва, 2023 г.

1. Введение

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. В целях настоящей Методики расчета «TINKOFF GOLD INDEX» (далее — Методика) применяются следующие термины и определения:
- Индекс — «TINKOFF GOLD INDEX».
 - Физическое золото — 1 грамм золота, биржевые торги которым осуществляются на рынке Драгоценных металлов ПАО Московская биржа, поставка которого осуществляется в обезличенном виде на металлический счет участника клиринга, открытый в Национальном Клиринговом Центре, с расчетами «завтра», код инструмента «GLDRUB_TOM».
 - Калькулирующий агент — лицо, осуществляющее расчет Индекса — АО «Тинькофф Банк».
 - Администратор — АО «Тинькофф Банк», действующее на основании договора с ООО «Тинькофф Капитал», осуществляющее деятельность по сбору данных, применению методологии, расчету и публикации значений индикатора и расчетных стоимостей финансовых инструментов, а также их распространению среди инвесторов.
 - Комитет по индикаторам — коллегиальный орган, осуществляющий разработку Методики, формирование и пересмотр Базы расчета, контроль расчета Индекса.
- 1.1.2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных федеральными законами и принятыми в соответствии с ними нормативными актами.
- 1.2. Общие положения
- 1.2.1. Индекс рассчитывается с целью отслеживания показателя доходности (динамики рыночной стоимости) Физического золота, выраженной в долларах США.
- 1.2.2. Доля Физического золота в составе Индекса — 100%.
- 1.2.3. Наименование и код Индекса:

Код	Полное наименование Индекса	Краткое наименование Индекса
GOLD	TINKOFF GOLD INDEX	TINKOFF GOLD INDEX

- 1.2.4. Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется при необходимости и по решению Калькулирующего агента.

2. Расчет Индекса

2.1. Порядок расчета ценового Индекса

- 2.1.1. Расчет значений ценового Индекса осуществляется с периодичностью один раз в час с 9:50 до 23:50 по московскому времени. Значения ценового Индекса по состоянию на конец дня (значения закрытия) рассчитывается в 05:04 по московскому времени.
- 2.1.2. Значение индекса Золота рассчитывается как отношение стоимости золота в валюте расчета Индикатора по состоянию на момент расчета к стоимости золота по состоянию на первый день расчета индекса по следующей формуле:

$$Sub_Igt = GLDRUB_{TOM_t} * Lt,$$

где:

Sub_Igt — значение Суб-индекса Золота на t-ый момент расчета;
GLDRUB_TOMt — цена золота в валюте расчета Индикатора по состоянию на t-ый момент расчета;
Lt — количество лотов инструмента GLDRUB_TOM в суб-индексе по состоянию на t-ый момент.

- 2.1.3. Расчет значений Индекса производится с точностью до двух знаков после запятой.
- 2.1.4. Дата старта Индекса — 01.01.1990, значение Индекса на начало этого дня — 100 пунктов.
- 2.1.5. Дата первого произведенного расчета Индекса Калькулирующим агентом — 01.01.2021.

2.2. Определение цены Физического золота.

- 2.2.1. Для определения цены Физического золота Pt в долларах США используются цены последних сделок с Физическим золотом в рублях, а также котировки валютной пары Рубль/Доллар с расчетами «завтра» на конец часа согласно п. 2.1.1 настоящей Методики (или цены закрытия — на конец дня), совершаемых на организованных торгах ПАО Московская биржа.

3. Формирование Базы Расчета Индекса

3.1. База Расчета Индекса на 100% состоит из Физического золота.

4. Прочие условия

4.1. В случае возникновения технического сбоя при расчете Индекса, либо технического сбоя в ходе торгов ценными бумагами, либо получения некорректной ценовой информации, необходимой для расчета Индекса, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений. Указанный перерасчет осуществляется в минимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя.

4.2. В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексом стоимости Физического золота, Калькулирующий агент вправе предпринять любые действия, необходимые для обеспечения адекватности Индекса.