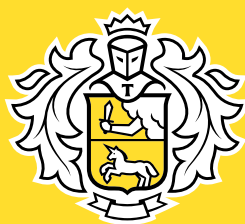


# **Изменения в Методику расчета Индикатора « TINKOFF AGGREGATE EUROBOND HIGH YIELD INDEX EUR »**

Дата вступления в силу изменений: 19.08.2022 г.



**ТИНЬКОФФ**

## I. Перечень изменений.

### 1. Внесены изменения в пункт 1.1.1.

- Добавлен термин «Администратор».

#### Старая редакция

Пункта 1.1.1

1.1.1. В целях настоящей Методики расчета Индекса TINKOFF AGGREGATE EUROBOND HIGH YIELD INDEX EUR (далее — Методика) применяются следующие термины и определения:

- База расчета — список ценных бумаг для расчета Индекса.
- Удельный вес Финансового инструмента — доля стоимости Финансового инструмента в суммарной стоимости всех Финансовых инструментов в Базе расчета, выраженная в процентах.
- Финансовый инструмент — Облигации хозяйственных обществ, организаций, регионов, муниципальных образований, государств.
- Биржа — биржи Российской Федерации и биржи, расположенные в иностранных государствах, в соответствии с перечнями, определенными Указанием Банка России от 05.09.2016 г. № 4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов».
- Эмитент — эмитент облигаций.
- Облигации — облигации, допущенные к организованным торгам на биржах.
- Калькулирующий агент — лицо, осуществляющее расчет Индекса — АО «Тинькофф Банк».

#### Новая редакция

Пункта 3.1.3

1.1.1. В целях настоящей Методики расчета Индекса TINKOFF AGGREGATE EUROBOND HIGH YIELD INDEX EUR (далее — Методика) применяются следующие термины и определения:

- База расчета — список ценных бумаг для расчета Индекса.
- Удельный вес — доля стоимости Финансового инструмента в суммарной стоимости всех Финансовых инструментов в Базе расчета, выраженная в процентах.
- Финансовый инструмент — Облигации хозяйственных обществ, организаций, регионов, муниципальных образований, государств.
- Биржа — биржи Российской Федерации и биржи, расположенные в иностранных государствах, в соответствии с перечнями, определенными Указанием Банка России от 05.09.2016 г. № 4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов».
- Эмитент — эмитент облигаций.
- Облигации — облигации, допущенные к организованным торгам на Биржах.
- Калькулирующий агент — лицо, осуществляющее расчет Индекса — АО «Тинькофф Банк».
- Администратор — лицо, осуществляющее разработку Методики, формирование и пересмотр Базы расчета, контроль расчета Индекса — АО «Тинькофф Банк».

### 2. Внесены изменения в пункт 1.2.1.

#### Старая редакция

Пункта 1.2.1

Индекс рассчитывается с целью отслеживания показателя накопленной доходности сбалансированного портфеля еврооблигаций компаний умеренной кредитоспособности со всего мира, номинированных в евро.

#### Новая редакция

Пункта 1.2.1

Индекс рассчитывается с целью отслеживания показателя накопленной доходности сбалансированного портфеля Облигаций компаний умеренной кредитоспособности со всего мира, номинированных в евро.

### 3. Внесены изменения в пункт 1.2.4.

#### Старая редакция

Пункта 1.2.4

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

#### Новая редакция

Пункта 1.2.4

Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется при необходимости и по решению Администратора.

### 4. Внесены изменения в раздел 2.

- Удален подраздел 2.1. Порядок расчета Индекса, изменен уровень нумерации.
- Изменены пункты 2.1.1, 2.1.11

- Добавлены пункты 2.11, 2.12.

#### Старая редакция

#### Новая редакция

Раздела 2.

Раздела 2.

- 2.1. Порядок расчета Индекса.
- 2.1.1. Индекс облигаций рассчитывается на основании информации о сделках, совершаемых на торгах Бирж согласно п.1.1.1. с Облигациями каждый торговый день.
- 2.1.11. В случае приостановки (прекращения) торгов выпуском Облигаций, включенным в Базу расчета Индекса облигаций, для расчета Индекса в период приостановки торгов выпуском облигаций (до момента возобновления торгов или до даты исключения выпуска облигаций из Базы расчета) используется последнее значение цены выпуска облигаций.

- 2.1. Индекс облигаций рассчитывается на основании информации о сделках, совершаемых на торгах Бирж с Облигациями каждый торговый день.
- 2.11. Для определения цены i-ой Облигации (Pi) используются следующие котировки:
- Последняя Индикативная цена (Last Price), рассчитываемая интегратором финансовой информации Twelve Data ;
  - Последняя Индикативная цена (Last Price), рассчитываемая интегратором финансовой информации RU Data.
- 2.12. В случае отсутствия рыночной информации о котировках в текущем дне используется цена закрытия предыдущего дня.
- 2.13. В случае приостановки (прекращения) торгов выпуском Облигаций, включенным в Базу расчета Индекса облигаций, для расчета Индекса в период приостановки торгов выпуском облигаций (до момента возобновления торгов или до даты исключения выпуска облигаций из Базы расчета) используется последнее значение цены выпуска облигаций, если иное не установлено Администратором.

#### 5. Внесены изменения в раздел 3.

- Удален подраздел 3.4. Порядок пересмотра Базы расчета Индекса, изменен уровень нумерации.
- Изменен пункт 3.4.1.
- Изменен пункт 3.4.3: добавлен подпункт.
- Добавлены пункты 3.4, 3.5.

#### Старая редакция

#### Новая редакция

Раздела 3.

Раздела 3.

3. Формирование и пересмотр Базы Расчета Индекса
- 3.1. База расчета содержит наименования Эмитентов Облигаций с указанием на код выпуска, а также ISIN коды выпусков.
- 3.2. Количество выпусков Облигаций, входящих в Базу расчета, определяется исходя из общего количества указанных ценных бумаг, находящихся в обращении на Биржах, их ликвидности и соответствия требованиям для включения в Базу расчета, и должно представлять 40 или более эмитентов облигаций.
- 3.3. Облигации могут быть включены в Базу расчета Индекса облигаций, если они соответствуют следующим требованиям:
- Выпуск облигаций номинирован в евро;
  - Выпуск облигаций включен в список ценных бумаг, допущенных к торгам на одной из Бирж;
  - Выпуск облигаций либо его эмитент (оферент) имеет кредитный рейтинг "B" и выше от агентств Standard & Poors или Fitch, либо "B2" и выше от агентства Moody's;

3. Формирование и пересмотр Базы Расчета Индекса
- 3.1. База расчета содержит наименования Эмитентов Облигаций с указанием на код выпуска, а также ISIN-коды выпусков.
- 3.2. Количество выпусков Облигаций, входящих в Базу расчета, определяется исходя из общего количества указанных ценных бумаг, находящихся в обращении на Биржах, их ликвидности и соответствия требованиям для включения в Базу расчета.
- 3.3. Облигации могут быть включены в Базу расчета Индекса облигаций, если они соответствуют следующим требованиям:
- Выпуск облигаций номинирован в евро;
  - Выпуск облигаций включен в список ценных бумаг, допущенных к торгам на одной из Бирж;
  - Выпуск облигаций либо его эмитент (оферент) имеет кредитный рейтинг "B" и выше от агентств Standard & Poors или Fitch, либо "B2" и выше от агентства Moody's;

**Старая редакция****Новая редакция**

- |   |  |
|---|--|
| <ul style="list-style-type: none"> <li>• Объем выпуска облигаций в обращении превышает 100 млн евро.</li> </ul> <p>3.4. Порядок пересмотра Базы расчета Индекса.</p> <p>3.4.1. Включение облигаций в Базу расчета и исключение облигаций из Базы расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета решением Калькулирующего агента.</p> <p>3.4.2. Очередной пересмотр Базы расчета осуществляется не чаще одного раза в полугодие, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Пересмотренная База Расчета вступает в силу по итогам 3-й пятницы февраля и августа.</p> <p>3.4.3. Внеочередной пересмотр Базы расчета может быть осуществлен в случае возникновения следующих событий:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• При прекращении биржевых торгов соответствующим выпуском Облигаций может быть принято решение об исключении Облигаций этого выпуска из Базы расчета.</li> <li>• В случае неисполнения Эмитентом Облигаций, включенных в Базу расчета, в полном объеме обязательства по выплате купонного дохода, выкупу по оферте, погашению выпуска или выпусков Облигаций данного Эмитента, может быть принято решение об исключении выпусков Облигаций из Базы расчета.</li> <li>• В случае наступления иных событий, не предусмотренных настоящей Методикой, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчет Индекса облигаций, в Базу расчета и/или параметры Облигаций могут быть внесены необходимые изменения.</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>• Объем выпуска облигаций в обращении превышает 100 млн евро.</li> </ul> <p>3.4. При наличии у одного Эмитента нескольких выпусков, удовлетворяющих требованиям пункта 3.3 Методики, в Базу расчета допускается включение только одного выпуска.</p> <p>3.5. Удельный вес одного выпуска не должен превышать 10%.</p> <p>3.6. Включение облигаций в Базу расчета и исключение облигаций из Базы расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета решением Администратора.</p> <p>3.7. Очередной пересмотр Базы расчета осуществляется один раз в полугодие, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Пересмотренная База Расчета вступает в силу по итогам 3-й пятницы февраля и августа.</p> <p>3.8. Внеочередной пересмотр Базы расчета может быть осуществлен в случае возникновения следующих событий:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• При превышении отдельной облигацией в ходе торгов фактического веса 10%.</li> <li>• При прекращении биржевых торгов соответствующим выпуском Облигаций может быть принято решение об исключении Облигаций этого выпуска из Базы расчета.</li> <li>• В случае неисполнения Эмитентом Облигаций, включенных в Базу расчета, в полном объеме обязательства по выплате купонного дохода, выкупу по оферте, погашению выпуска или выпусков Облигаций данного Эмитента, может быть принято решение об исключении выпусков Облигаций из Базы расчета.</li> <li>• В случае наступления иных событий, не предусмотренных настоящей Методикой, результаты которых могут оказать существенное влияние на расчет Индекса облигаций, в Базу расчета и/или параметры Облигаций могут быть внесены необходимые изменения.</li> </ul> |
|---|--|
6. Внесены изменения в пункт 4.2.

**Старая редакция****Новая редакция**

Пункта 4.2.

Пункта 4.2.

В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексом

В случае наступления обстоятельств, которые могут негативно повлиять на адекватность отражения Индексом накопленной стоимости портфеля облигаций Индекса, Администратор вправе предпринять любые действия, необходимые для обеспечения адекватности Индекса, в том числе исключить Облигации из Базы расчета Индекса, включить Облигации в Базу расчета Индекса, установить иные значения параметров, используемых для расчета показателей, предусмотренных настоящей Методикой и т.д.

накопленной стоимости портфеля облигаций Индекса, Калькулирующий агент вправе предпринять любые действия,

необходимые для обеспечения адекватности Индекса, в том числе исключить Облигации из Базы расчета Индекса,

включить Облигации в Базу расчета Индекса, установить иные значения параметров, используемых для расчета показателей, предусмотренных настоящей Методикой и т.д.

## II. Приложения

1. Методика расчета Индикатора « TINKOFF AGGREGATE EUROBOND HIGH YIELD INDEX EUR » (редакция 2).