

Методика расчета
«TINKOFF GOLD INDEX»



ТИНЬКОФФ

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».

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 ценового Индекса рассчитывается как отношение стоимости Физического золота по состоянию на момент расчета к значению Делителя по следующей формуле:

$$I p_n = \frac{P_t}{D_t}$$

где:

$I p_t$ — значение ценового Индекса на t-ый момент расчета;

P_t — стоимость Физического золота, выраженная в долларах США, по состоянию на t-ый момент расчета, определяемая в соответствии с п. 2.2.1 настоящей Методики;

D_t — значение Делителя на t-ый момент расчета ценового Индекса.

2.1.3. Делитель представляет собой значение стоимости Физического золота на первый день расчета, скорректированное с учетом произошедших изменений параметров Физического золота и начального значения ценового Индекса. В первый день расчета ценового Индекса Делитель рассчитывается по формуле:

$$D_1 = \frac{P_1}{I p_1}$$

где:

P_1 — стоимость Физического золота на дату первого произведенного расчета ценового Индекса;

$I p_1$ — значение ценового Индекса на дату первого произведенного расчета.

2.1.4. В последующие дни Делитель остается без изменений ($D_t = D_{t-1}$), кроме случаев, описанных в п. 2.3 настоящей Методики.

2.1.5. Расчет значений Индекса производится с точностью до двух знаков после запятой.

- 2.1.6. Дата старта Индекса — 01.01.1990, значение Индекса на начало этого дня — 100 пунктов.
- 2.1.7. Дата первого произведенного расчета Индекса Калькулирующим агентом — 01.01.2021.
- 2.2. Определение цены Физического золота.
 - 2.2.1. Для определения цены Физического золота P_t 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.
- 2.3. Расчет Делителя.
 - 2.3.1. Перерасчет Делителя D_t осуществляется в случае изменения параметров Физического золота.
 - 2.3.2. Расчет Делителя D_t осуществляется по следующей формуле:

$$D_{t+1} = D_t \cdot \frac{P_{t+1}}{P_t}$$

где:

D_{t+1} — новое значение Делителя;

D_t — текущее значение Делителя;

P_t — стоимость Физического золота до наступления обстоятельства, являющегося основанием для расчета нового значения Делителя;

P_{t+1} - стоимость Физического золота после наступления обстоятельства, являющегося основанием для расчета нового значения Делителя;

t — момент пересчета Делителя.

Расчет Делителя D_t осуществляется с точностью до четырех знаков после запятой по правилу математического округления.

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.