

Изменения в Методику расчета Индикатора «TINKOFF ALL-WEATHER INDEX (RUB)»

Дата вступления в силу изменений: 22.12.2021 г.



ТИНЬКОФФ

Перечень изменений

1. Внесены изменения в пункт 2.1.2. День расчета ограничительных коэффициентов перенесен на третью пятницу октября.

Старая редакция	Новая редакция
Пункт 2.1.2	Пункт 2.1.2
Очередной пересмотр ограничительных коэффициентов осуществляется 1 раз в год, по итогам третьего четверга октября. Расчет Индикатора с использованием новых коэффициентов осуществляется, начиная с торгового дня, следующего за третьим четвергом октября.	Очередной пересмотр ограничительных коэффициентов осуществляется 1 раз в год, по итогам третьей пятницы октября. Расчет Индикатора с использованием новых коэффициентов осуществляется, начиная с торгового дня, следующего за третьей пятницей октября.

2. Внесены изменения в пункт 2.4.3. Изменено ограничение на вес одной бумаги в Суб-Индексе Акций — снижение доли до 20%.

Старая редакция	Новая редакция
Абзац 6 Пункта 2.4.3	Абзац 6 Пункта 2.4.3
Сар — предельно допустимый вес на одного эмитента, равный 100 процентам для данного Индикатора.	Сар — предельно допустимый вес на одного эмитента, равный 20 процентам для данного Индикатора.

3. Внесены изменения в пункт 3.1. Для Суб-Индекса Акций добавлены принципы формирования Базы Расчета — подпункты 3.1.4 и 3.1.5

Старая редакция	Новая редакция
Пункт 3.1	Пункт 3.1
3.1. Принципы формирования Базы Расчета Суб-индекса Акций.	3.1. Принципы формирования Базы Расчета Суб-индекса Акций.
3.1.1. База Расчета содержит наименования Эмитентов Акций, указание на категорию (тип) ценных бумаг, наименования Эмитентов депозитарных расписок, а также ISIN код каждой Акции.	3.1.1. База Расчета содержит наименования Эмитентов Акций, указание на категорию (тип) ценных бумаг, наименования Эмитентов депозитарных расписок, а также ISIN код каждой Акции.
3.1.2. База Расчета Суб-индекса полной доходности является аналогичной Базе Расчета ценового Суб-индекса.	3.1.2. База Расчета Суб-индекса полной доходности является аналогичной Базе Расчета ценового Суб-индекса.
3.1.3. В Базу Расчета включаются акции 15 российских компаний с наибольшей рыночной стоимостью акций в свободном обращении на дату формирования Базы Расчета.	3.1.3. В Базу Расчета включаются акции 15 российских компаний с наибольшей рыночной стоимостью акций в свободном обращении на дату формирования Базы Расчета.
	3.1.4. При формировании новой Базы расчета Акции, входящие в состав текущей Базы расчета и имеющие порядковый номер в ранкинге новой Базы расчета больше 15, исключаются при условии, что разница в рыночной стоимости в свободном обращении между данной Акцией и 15-й Акцией в ранкинге новой Базы расчета составляет более 15%.
	3.1.5. При наличии у Эмитента нескольких типов акций в Базу расчета Суб-индекса акций по решению Калькулирующего агента включается только одна ценная бумага.

4. Внесены изменения в пункт 3.2.2. Удалено ограничение нижней границы срока до погашения облигаций в Суб-индексе краткосрочных облигаций.

Старая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных государственных облигаций включаются до 3 облигаций федерального займа Минфина РФ, отобранных по решению Калькулирующего агента, количество дней до погашения которых на дату формирования Базы расчета составляет не менее 30 и не более 700;

Новая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных государственных облигаций включаются до 3 облигаций федерального займа Минфина РФ, отобранных по решению Калькулирующего агента, количество дней до погашения которых на дату формирования Базы расчета составляет не более 700;

5. Внесены изменения в пункт 3.3.1. Режим пересмотра Базы Расчета изменен на полугодовой.

Старая редакция

Пункт 3.3.1

Пересмотр Базы Расчета Суб-индексов Акции и Облигаций осуществляется ежеквартально, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Пересмотренная База Расчета вступает в силу по итогам 3-й пятницы марта, июня, сентября и декабря.

Новая редакция

Пункт 3.3.1

Пересмотр Базы Расчета и Ребалансировка Суб-индексов Акции и Облигаций осуществляется раз в полгода по итогам третьей пятницы апреля и октября, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Расчет Индикатора с использованием новой Базы Расчета осуществляется, начиная с торгового дня, следующего за третьей пятницей апреля и октября.

6. Внесены изменения в пункт 3.3.2. Удалены требования к структуре, действовавшие в 2021 г.

Старая редакция

Пункт 3.3.2

3.3.2. Внеочередной пересмотр Базы расчета может быть осуществлен по решению Калькулирующего агента:

- При наступлении событий, которые могут оказать существенное влияние на расчет Индикатора и любого из его Суб-индексов;
- При превышении отдельной акцией или облигацией в ходе торгов фактического веса, равного 13%, с 1 января 2022 года — 12%, с 1 июля 2022 года — 11%, с 1 января 2023 года — 10%.

Новая редакция

Пункт 3.3.2

3.3.2. Внеочередной пересмотр Базы расчета может быть осуществлен по решению Калькулирующего агента:

- При наступлении событий, которые могут оказать существенное влияние на расчет Индикатора и любого из его Суб-индексов;
- При превышении отдельной акцией или облигацией в ходе торгов фактического веса, равного 12%, с 1 июля 2022 года — 11%, с 1 января 2023 года — 10%.

Приложения

1. Методика расчета Индикатора «TINKOFF ALL-WEATHER INDEX (RUB)» (редакция 2).