

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

Дата вступления в силу изменений: 22.12.2021 г.



ТИНЬКОФФ

Перечень изменений

1. Внесены изменения в пункт 2.1.1. Доля Суб-Индекса Долгосрочных государственных облигаций снижена до 10%, доля Суб-Индекса Долгосрочных корпоративных облигаций увеличена до 15%.

Старая редакция			Новая редакция		
Таблица в пункте 2.1.1			Таблица в пункте 2.1.1		
Суб-индекс	Валюта	Целевой вес на дату ограничения	Суб-индекс	Валюта	Целевой вес на дату ограничения
Суб-индекс Акции	USD	25.0%	Суб-индекс Акции	USD	25.0%
Суб-индекс Долгосрочных государственных облигаций	USD	12.5%	Суб-индекс Долгосрочных государственных облигаций	USD	10%
Суб-индекс Долгосрочных корпоративных облигаций	USD	12.5%	Суб-индекс Долгосрочных корпоративных облигаций	USD	15%
Суб-индекс Краткосрочных корпоративных облигаций	USD	25.0%	Суб-индекс Краткосрочных корпоративных облигаций	USD	25.0%
Суб-индекс Золота	RUB	25.0%	Суб-индекс Золота	RUB	25.0%

2. 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.

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 50 компаний США с наибольшей рыночной стоимостью акций в свободном обращении на дату формирования Базы Расчета.	3.1.3. В Базу Расчета включаются акции 50 компаний США 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 50, исключаются при условии, что разница в рыночной стоимости в свободном обращении между данной Акцией и 50-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	Новая редакция
Абзац 3 пункта 3.2.2:	Абзац 3 пункта 3.2.2:
В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных корпоративных облигаций включаются 10 корпоративных облигаций США, отобранных по решению Калькулирующего агента, количество дней до погашения которых на дату формирования Базы расчета составляет не менее 30 и не более 700, рыночная капитализация эмитента составляет не менее 70 млрд долларов, рейтинг выпуска не ниже BBB- (по методологии S&P) и/или не ниже BBB- (FITCH) и/или не ниже Baa3 (Moody's). В Базу расчета может входить один выпуск Облигации одного эмитента;	В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных корпоративных облигаций включаются 10 корпоративных облигаций США, отобранных по решению Калькулирующего агента, количество дней до погашения которых на дату формирования Базы расчета составляет не более 700, рыночная капитализация эмитента составляет не менее 70 млрд долларов, рейтинг выпуска не ниже BBB- (по методологии S&P) и/или не ниже BBB- (FITCH) и/или не ниже Baa3 (Moody's). В Базу расчета может входить один выпуск Облигации одного эмитента;

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

Старая редакция	Новая редакция
Пункт 3.3.1 Пересмотр Базы Расчета Суб-индексов Акций 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.	Пункт 3.3.1 Пересмотр Базы Расчета и Ребалансировка Суб-индексов Акций и Облигаций осуществляется ежегодно по итогам третьей пятницы октября, за исключением случаев, предусмотренных настоящей Методикой. Расчет Индикатора с использованием новой Базы Расчета осуществляется, начиная с торгового дня, следующего за третьей пятницей октября.

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

Старая редакция	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 13%, с 1 января 2022 года — 12%, с 1 июля 2022 года — 11%, с 1 января 2023 года — 10%.	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%.

II Приложения

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