

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

Дата вступления в силу изменений: 25.10.2021 г.



ТИНЬКОФФ

1. Основные изменения:

- Внесены изменения в пункт 1.2.1. Добавлены государственные и корпоративные облигации Швейцарии.
- Внесены изменения в пункт 2.4.3. Была заменена формула расчета суб-индекса облигаций, добавлена корректировка на валютный курс:

$$\text{Sub_Ip}_n = \text{Sub_Ip}_{n-1} \cdot \frac{\sum_{i=1}^N \left(\frac{P_{i,n}}{100} \cdot FV_{i,n} + A_{i,n} + G_{i,n} \right) \cdot N_{i,b} \cdot W_{i,b} \cdot CR_{i,n}}{\sum_{i=1}^N \left(\frac{P_{i,n-1}}{100} \cdot FV_{i,n-1} + A_{i,n-1} \right) \cdot N_{i,b} \cdot W_{i,b} \cdot CR_{i,n-1}}$$

$CR_{i,n}$ — коэффициент, соответствующий единице в случае, если i -й выпуск номинирован в валюте Евро, и соответствующий валютному курсу Евро по отношению к доллару США на конец часа (или курс закрытия — на конец дня) в случае, если i -й выпуск номинирован в валюте доллар США, в момент времени n ;

- Внесены изменения в пункт 2.4.6. Была заменена формула расчета весового коэффициента i -ой Облигации по состоянию на b -ый момент пересмотра Базы расчета Суб-индексов:

$$\text{Weight}_i = \frac{\frac{P_{i,b}}{100} \cdot FV_{i,b} + A_{i,b}}{\sum_{i=1}^N \left(\frac{P_{i,b}}{100} \cdot FV_{i,b} + A_{i,b} \right) \cdot N_{i,b} \cdot W_{i,b} \cdot CR_{i,n-1}} = \frac{1}{N}$$

- Внесены изменения в пункт 3.2.2. В базу расчета суб-индексов облигаций добавлены государственные и корпоративные облигации Швейцарии.