

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

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 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 Еврозоны с наибольшей рыночной стоимостью акций в свободном обращении на дату формирования Базы Расчета.	3.1.3. В Базу Расчета включаются акции 50 компаний Еврозоны 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 ранжировке новой Базы расчета больше 50, исключаются при условии, что разница в рыночной стоимости в свободном обращении между данной Ацией и 50-й Ацией в ранжировке 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.

3. 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 облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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;

Новая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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;

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

Старая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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;

Новая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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 3.3.2. Удалены требования к структуре, действовавшие в 2021 г.

Старая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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;

Новая редакция

Абзац 3 пункта 3.2.2:

В Базу расчета Суб-индекса краткосрочных облигаций включаются 10 облигаций государственных и/или корпоративных эмитентов из стран Еврозоны, 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 10 млрд Евро, 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;

## Приложения

1. Методика расчета Индикатора «TINKOFF ALL-WEATHER INDEX (EUR)» (редакция 3).