

Методика расчета индекса «Open All-Weather»

1. Общие положения

1.1. Методика определяет порядок расчета значений Индекса, порядок и сроки раскрытия значений Индекса, а также порядок внесения изменений в Базу расчета.

1.2. Методика разработана совместно с ООО УК «ОТКРЫТИЕ».

2. Термины и определения

2.1. В Методике используются следующие термины и определения:

Базовый актив - ценная бумага иностранного биржевого инвестиционного фонда, допущенная к торгам на иностранной бирже и входящая в Список предметов обязательств из договоров, заключенных не на организованных торгах, в отношении которых Клиринговый центр оказывает клиринговые услуги.

База расчета - перечень Базовых активов, по которым рассчитываются значения Индекса.

Биржа - Публичное акционерное общество «Санкт-Петербургская биржа».

Индекс - индекс «Open All-Weather»: индикатор, не являющийся показателем, рассчитываемым организатором торговли в соответствии с нормативными актами Банка России, который отражает изменение суммарной стоимости Базовых активов, включенных в Базу расчета с учетом выплаченных дивидендов. Наименование Индекса на русском языке и тикер (аббревиатура) указаны в Приложении 1 к Методике.

Источники информации об эмитентах – официальные сайты Эмитентов в сети Интернет и (или) официальные сайты в сети Интернет, на которых Эмитентами в соответствии с применимым законодательством осуществляется раскрытие информации.

Клиринговый центр - Акционерное общество «Клиринговый центр МФБ».

Методика - настоящая Методика расчета Индекса.

Сайт - официальный сайт Биржи в сети Интернет.

Эмитент - акционерное общество, созданное в соответствии с законодательством США.

Значение Базового актива – значение показателя «Текущая цена рынка», рассчитанное для соответствующего Базового актива Клиринговым центром в соответствии с методикой, раскрытой на сайте Клирингового центра.

2.2. Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных документами Клирингового центра.

3. Расчет значений Индекса

3.1. Значение Индекса I_n в n -й момент расчета рассчитывается по формуле:

$$I_n = I_R \times \sum_{i=1}^k R_{i_n} \times w_{i_n}$$

Где:

I_R – значение Индекса на дату последнего пересмотра Базы расчета. На дату первого расчета значения Индекса, I_R имеет фиксированное значение I_0 ($I_R = I_0$), указанное в Приложении 1 к Методике.

R_{i_n} – показатель, рассчитываемый по формуле $R_{i_n} = \frac{P_{i_n+D}}{P_{i_R}}$, где:

- P_{i_n} – значение i -го Базового актива в n -й момент расчета.

- D – величина дивидендов, выплаченных между n -моментом расчета и датой последнего пересмотра Базы расчета, учитываемая нарастающим итогом. На дату первого расчета значения Индекса, D имеет фиксированное значение D_0 ($D = D_0$), указанное в Приложении 1 к Методике. До даты первого пересмотра Базы расчета, D определяется как учитываемая нарастающим итогом сумма дивидендов, выплаченных между n -моментом расчета и датой первого расчета значения Индекса, и значением D_0 .
- P_{i_R} – значение i -го Базового актива на дату последнего пересмотра Базы расчета. На дату первого расчета значения Индекса, P_{i_R} имеет фиксированное значение P_{i_0} ($P_{i_R} = P_{i_0}$), указанное в Приложении 1 к Методике.

w_{i_n} - вес i -го Базового актива в n -й момент расчета, который определяется по формуле: $w_{i_n} = \frac{R_{i_n}}{\sum_{i=1}^k R_{i_n}}$. На дату первого расчета значения Индекса, w_{i_n} имеет фиксированное значение w_0 ($w_{i_n} = w_0$), указанное в Приложении 1 к Методике.

k – количество Базовых активов, входящих в Базу расчета.

3.2. Значение Индекса рассчитывается в пунктах с точностью до второго знака после запятой по правилам математического округления.

3.3. Значения Индекса (в n -й момент расчета) рассчитываются в 19:00 по московскому времени каждого дня, в котором есть период (периоды) времени, в течение которого (которых) в соответствии с внутренними документами Клирингового центра могут направляться Оферты ОТС в отношении ценных бумаг, являющихся Базовыми активами, и в котором Клиринговым центром производится расчет Значений Базовых активов (далее – «День расчета значения Индекса»). Указанная периодичность может быть изменена Биржей по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ».

3.4. Информация о значениях Индекса раскрывается на Сайте не позднее, чем к 11:00 по московскому времени следующего Дня расчета значения Индекса.

3.5. В случае технического сбоя при расчете значений Индекса, приведшего к искажению данных, использовавшихся для расчета значений Индекса, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений Индекса за текущий и (или) предыдущий День расчета значения Индекса. Указанный перерасчет осуществляется в максимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя. При перерасчете Биржа вправе установить (изменить) значение показателей, используемых для расчета значений Индекса, используя данные, полученные из Источников информации об эмитентах.

4. База расчета

4.1. База расчета включает в себя 5 (пять) Базовых активов, если иное количество не установлено Биржей по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ». Включение Базовых активов в Базу расчета и исключение их из Базы расчета осуществляется при пересмотре Базы расчета.

4.2. Базовые активы включаются в Базу расчета Биржей по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ» при условии, что минимальный порог стоимости активов соответствующего иностранного биржевого инвестиционного фонда составляет 3 млрд. долларов США.

4.3. По каждому Базовому активу, включенному в Базу расчета, указывается следующая информация:

- сектор – справочная информация, в каком финансовом секторе сосредоточены активы иностранного биржевого фонда, ценные бумаги которого являются Базовым активом;
- наименование;
- тикер и международный код идентификации Базового актива (ISIN);
- весовой коэффициент на момент последнего пересмотра Базы расчета. На дату первого расчета значения Индекса используется значение w_0 .

4.4. База расчета раскрывается на Сайте.

4.5. База расчета на дату первого расчета значения Индекса и дата первого расчета значения Индекса указана в Приложении 1 к Методике.

4.6. База расчета подлежит очередному пересмотру ежегодно в последний в году День расчета значения Индекса. При очередном пересмотре Базы расчета балансируется количество Базовых

активов в Индексе на основании равных значений весов. По согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ» База расчета может не пересматриваться.

4.7. В случае возникновения корпоративного(-ых) события(-й), существенно влияющих на Базовые активы и/или их веса в Индексе, по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ» может быть проведен внеочередной пересмотр Базы расчета.

4.8. База расчета вступает в силу в дату, определенную Биржей по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ».

4.9. Биржа раскрывает на Сайте сообщение о пересмотре Базы расчета и новую Базу расчета. Сообщение раскрывается не позднее дня вступления в силу новой Базы расчета.

4.10. При формировании и пересмотре Базы расчета используются сведения, содержащиеся в Источниках информации об Эмитентах.

5. Заключительные положения

5.1. Методика, а также изменения к ней утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.

5.2. Информация об изменениях, внесенных в Методику, в том числе в форме новой редакции Методики, раскрывается Биржей на Сайте не позднее, чем за 1 (один) рабочий день до даты вступления в силу соответствующих изменений.

5.3. Изменения в Методику и даты вступления их в силу определяются Биржей по согласованию с ООО УК «ОТКРЫТИЕ».

Приложение 1
к Методике расчета индекса «Open All-Weather»

Наименование индекса на английском языке – «Open All-Weather».
 Наименование индекса на русском языке – «Открытие Всепогодный».
 Тикер индекса – SPBOAW.
 База расчета на дату первого расчета значения Индекса:

Сектор	Наименование Базового актива	Тикер	ISIN	Вес
Голубые фишки	SPDR S&P 500 ETF TRUST (U.S.)	SPY	US78462F1030	0.20
Развивающиеся рынки	iShares MSCI Emerging Markets ETF (U.S.)	EEM	US4642872349	0.18
Недвижимость	iShares U.S. Real Estate ETF (U.S.)	IYR	US4642877397	0.17
Корпоративные облигации	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF (U.S.)	LQD	US4642872422	0.21
Золото	SPDR Gold Shares(U.S.)	GLD	US78463V1070	0.24

Дата первого расчета значения Индекса: 30 июня 2020 года.

Значение $I_0 = 325.48$

Значение D_0, P_{i_0}, w_0 :

Тикер	D_0	P_{i_0}	w_0
SPY	3.55	320.62	0.20
EEM	0	44.71	0.18
IYR	0	92.61	0.17
LQD	0.34	128.02	0.21
GLD	0	143.33	0.24