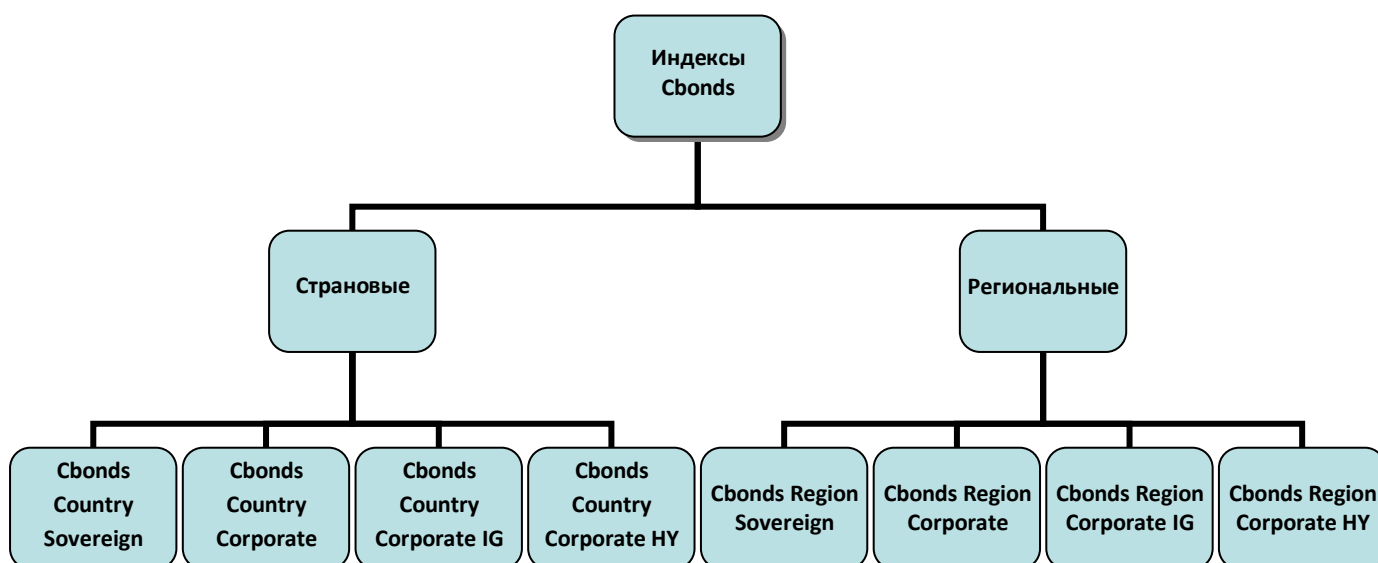


Методика расчета индексов доходности и ценовых индексов Cbonds

Иерархия семейств индексов



Содержание

Содержание	2
Формула расчета индекса.....	3
Расчет дополнительных показателей.....	4
Методика формирования индексного списка.....	6
Cbonds Country Sovereign	6
Cbonds Region Sovereign	7
Cbonds Country Corporate.....	8
Cbonds Region Corporate.....	9
Cbonds Country Corporate IG.....	10
Cbonds Region Corporate IG	11
Cbonds Country Corporate HY.....	12
Cbonds Region Corporate HY	13
Cbonds Green Bonds.....	13
Приложение 1: сводная таблица критериев индексных списков.....	14
Приложение 2: история изменений в методике расчета индексов	26

Формула расчета индекса

Предлагаемые компанией Cbonds индексы облигаций представляют собой индексы полной доходности (total return index) и рассчитываются по следующей формуле:

$$I_0 = 100 \quad I_t = I_{t-1} \frac{\sum_{i=1}^n [P_{i,t} + ACI_{i,t} + G_{i,t}] N_{i,t}}{\sum_{i=1}^n [P_{i,t-1} + ACI_{i,t-1}] N_{i,t}}$$

где:

n – количество эмиссий индексного списка;

$P_{i,t}$ – цена i -ой эмиссии в момент t (чистая, в денежном выражении);

$ACI_{i,t}$ - накопленный купонный доход по i -ой эмиссии в момент t (в день выплаты купона, который, соответственно, является и началом нового купонного периода, этот показатель равен нулю);

$G_{i,t}$ - купонные выплаты и/или выплаты в рамках амортизации, получаемые по i -ой эмиссии в момент времени t (показатель $G_{i,t}$ отличен от 0 лишь на дату выплаты купона и/или амортизационного погашения по i -той бумаге, когда он равен купонному платежу и/или амортизационной выплате);

$N_{i,t}$ - объем i -го выпуска облигаций из индексного списка (в штуках) в момент времени t .

Фактически выражение в числителе представляет собой капитализацию эмиссий индексного списка в момент t , выражение в знаменателе - капитализация в момент $t-1$.

Индекс рассчитывается один раз (на закрытие) каждый торговый день в начале следующего дня.

Кроме основного индекса рассчитывается также вспомогательный («конъюнктурный»), который представляет собой «ценовой» индекс и рассчитывается следующим образом:

$$IP_0 = 100 \quad IP_t = IP_{t-1} \frac{\sum_{i=1}^n P_{i,t} N_{i,t}}{\sum_{i=1}^n P_{i,t-1} N_{i,t}}$$

Обозначения соответствуют введенным ранее.

Расчет дополнительных показателей

Кроме индексов полной доходности и ценового индекса также рассчитываются показатели, характеризующие средневзвешенную доходность и дюрацию индексного портфеля.

Рассчитывается средневзвешенная доходность к погашению (учитывает внутригодовое реинвестирование купонов).

Средневзвешенная дюрация представляет собой усредненную по портфелю дюрацию, взвешивание осуществляется исходя из доли каждой бумаги в общей капитализации. В случае если по эмиссии рассчитана и дюрация к погашению, и дюрация к оферте, при расчете средневзвешенной дюрации индексного портфеля будет использован показатель дюрации к оферте.

$$D_p = \frac{\sum_i D_{i,t} [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}}{\sum_i [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}},$$

где:

D_p – дюрация по портфелю;

$D_{i,p}$ – дюрация эмиссии i в момент t .

Средневзвешенная доходность представляет собой взвешенную доходность бумаг, входящих в индексный портфель. Взвешивание осуществляется с учетом доли бумаги в капитализации рынка и дюрации. В случае если по эмиссии рассчитана и доходность к погашению, и доходность к оферте, при расчете средневзвешенной доходности индексного портфеля будет использован показатель доходности к оферте.

$$Y_p^* = \frac{\sum_i Y_{i,t}^* D_{i,t} [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}}{\sum_i D_{i,t} [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}}.$$

где:

Y_p^* – средневзвешенная доходность к погашению по портфелю;

$Y_{i,t}^*$ – доходность к погашению эмиссии i в момент t .

Средневзвешенный T-spread представляет собой усредненный по портфелю T-spread, взвешивание осуществляется исходя из доли каждой бумаги в общей капитализации.

$$Tspread_p = \frac{\sum_i Tspread_{i,t} [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}}{\sum_i [P_{i,t} + ACI_{i,t}] N_{i,t}},$$

где

$Tspread_p$ – T-spread по портфелю,

$Tspread_{i,t}$ – T-spread бумаги i в момент t ,

Подробная информация о расчете показателей НКД, доходности, дюрации и спреда приведена в [Справочнике к калькулятору](#).

Методика формирования индексного списка

Cbonds Country Sovereign

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации государственного сектора по стране, соответствующей конкретному значению “Country” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества выпусков, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества выпусков, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества выпусков, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.5, называются Индексными списками.
7. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
8. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Region Sovereign

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации государственного сектора по региону, соответствующему конкретному значению “Region” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества выпусков, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества выпусков, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества выпусков, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.5, называются Индексными списками.
7. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
8. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Country Corporate

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации корпоративного сектора по стране, соответствующей конкретному значению “Country” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества выпусков, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD. (Для индекса Cbonds Russia Corporate CNY Index исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от CNY)
4. Из общего множества выпусков, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества выпусков, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн. (Для индекса Cbonds Russia Corporate CNY Index – ¥500 млн)
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Region Corporate

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации корпоративного сектора по региону, соответствующему конкретному значению “Region” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Country Corporate IG

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации корпоративного сектора по стране, соответствующей конкретному значению “Country” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества выпусков, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества выпусков, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества выпусков, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже Baa3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Region Corporate IG

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации корпоративного сектора по региону, соответствующему конкретному значению “Region” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже Baa3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Country Corporate HY

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации корпоративного сектора по стране, соответствующей конкретному значению “Country” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества выпусков, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества выпусков, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества выпусков, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Region Corporate HY

1. Для расчета индексов рассматриваются все облигации и еврооблигации государственного сектора по региону, соответствующему конкретному значению “Region” из названия индекса. Тип долга – старший необеспеченный (также подразумевается, что бумага не является секьюритизированной или ипотечной), структура эмиссии – неконвертируемые еврооблигации и облигации.
2. Для включения в индексы рассматриваются бескупонные/купонные еврооблигации и облигации с фиксированной ставкой купона, имеющие конечный срок обращения.
3. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 2, исключаются бумаги с валютой эмиссии, отличной от USD.
4. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 3, исключаются бумаги с оставшимся сроком до погашения менее 360 дней. Для бумаг с досрочным погашением в качестве даты погашения рассматривается дата оферты.
5. Из общего множества еврооблигаций, образуемых п. 4, исключаются низколиквидные бумаги, определяемые следующими критериями:
 - 5.1. Объем эмиссии менее \$500 млн.
 - 5.2. Количество дней, когда по данному выпуску еврооблигаций выставляли котировки на сайте Cbonds, менее 16 торговых дней прошлого месяца.
6. Из общего множества выпусков, образуемых п. 5, отбираются эмиссии с кредитным рейтингом не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.
7. Списки, полученные для каждого индекса в результате действий, указанных в п.1 – п.6, называются Индексными списками.
8. Пересмотр списка в соответствии с данной методикой, а также включение новых эмиссий производится Cbonds ежемесячно.
9. Индексы рассчитываются ежедневно на даты, в которые обновлены котировки не менее чем по 50% бумаг из индексного портфеля.

Cbonds Green Bonds

Линейка индексов состоит из подгрупп индексов:

1. Cbonds World Sovereign Green
2. Cbonds World Corporate Green
3. Cbonds World Corporate IG Green
4. Cbonds World Corporate HY Green

Критерии формирования индексного списка повторяют критерии соответствующих индексов с одним лишь дополнительным условием – облигации имеют классификацию – Green Bonds.

Приложение 1: сводная таблица критериев индексных списков

Индекс	Субрегион	Страна	Вид бумаг	Купон	Сегмент	Валюта	Мин. срок обращения (дни)	Макс. срок обращения (дни)	Рейтинг	Периодичность пересмотра	Дата начала расчета индекса	Критерий ликвидности: мин. кол-во торг. дней в прошлом периоде	Мин. объем эмиссии
Cbonds Country Sovereign													
Cbonds Indonesia Sovereign USD Index	Азия (искл. Японию)	Индонезия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Malaysia Sovereign USD Index	Азия (искл. Японию)	Малайзия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Pakistan Sovereign USD Index	Азия (искл. Японию)	Пакистан	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Philippines Sovereign USD Index	Азия (искл. Японию)	Филиппины	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Sri Lanka Sovereign USD Index	Азия (искл. Японию)	Шри-Ланка	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Ghana Sovereign USD Index	Африка	Гана	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Egypt Sovereign USD Index	Африка	Египет	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Cote d'Ivoire Sovereign USD Index	Африка	Кот д'Ивуар	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Nigeria Sovereign USD Index	Африка	Нигерия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds South Africa Sovereign USD Index	Африка	ЮАР	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Bahrain Sovereign USD Index	Ближний Восток	Бахрейн	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Jordan Sovereign USD Index	Ближний Восток	Иордания	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Qatar Sovereign USD Index	Ближний Восток	Катар	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Lebanon Sovereign USD Index	Ближний Восток	Ливан	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Oman Sovereign USD Index	Ближний Восток	Оман	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Saudi Arabia Sovereign USD Index	Ближний Восток	Саудовская Аравия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Turkey Sovereign USD Index	Ближний Восток	Турция	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Hungary Sovereign USD Index	Восточная Европа	Венгрия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Poland Sovereign USD Index	Восточная Европа	Польша	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Romania Sovereign USD Index	Восточная Европа	Румыния	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Argentina Sovereign USD Index	Латинская Америка	Аргентина	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Brazil Sovereign USD Index	Латинская Америка	Бразилия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Guatemala Sovereign USD Index	Латинская Америка	Гватемала	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000

Cbonds Dominican Republic Sovereign USD Index	Латинская Америка	Доминиканская Республика	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Colombia Sovereign USD Index	Латинская Америка	Колумбия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Costa Rica Sovereign USD Index	Латинская Америка	Коста-Рика	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Mexico Sovereign USD Index	Латинская Америка	Мексика	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Panama Sovereign USD Index	Латинская Америка	Панама	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Paraguay Sovereign USD Index	Латинская Америка	Парагвай	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Peru Sovereign USD Index	Латинская Америка	Перу	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds El Salvador Sovereign USD Index	Латинская Америка	Сальвадор	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Uruguay Sovereign USD Index	Латинская Америка	Уругвай	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Chile Sovereign USD Index	Латинская Америка	Чили	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Jamaica Sovereign USD Index	Латинская Америка	Ямайка	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000
Cbonds Israel Sovereign USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Израиль	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Republic of Korea Sovereign USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Республика Корея	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2019	16	500 000 000

Cbonds Kazakhstan Sovereign USD Index	СНГ	Казахстан	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Russia Sovereign USD Index	СНГ	Россия	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Ukraine Sovereign USD Index	СНГ	Украина	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Region Sovereign

Cbonds Asia Sovereign USD Index	Азия	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds Africa Sovereign USD Index	Африка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds Middle East Sovereign USD Index	Ближний Восток	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds Eastern Europe Sovereign USD Index	Восточная Европа	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds Latin America Sovereign USD Index	Латинская Америка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds CIS Sovereign USD Index	СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2011	16	500 000 000
Cbonds EM Sovereign USD Index	Развивающиеся рынки и СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	не выше Ваа1/BBB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Country Corporate

Cbonds Hong Kong Corporate USD Index	Азия (искл. Японию)	Гонконг	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds India Corporate USD Index	Азия (искл. Японию)	Индия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Indonesia Corporate USD Index	Азия (искл. Японию)	Индонезия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds China Corporate USD Index	Азия (искл. Японию)	Китай	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Malaysia Corporate USD Index	Азия (искл. Японию)	Малайзия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds South Africa Corporate USD Index	Африка	ЮАР	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Qatar Corporate USD Index	Ближний Восток	Катар	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds United Arab Emirates Corporate USD Index	Ближний Восток	ОАЭ	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Saudi Arabia Corporate USD Index	Ближний Восток	Саудовская Аравия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Turkey Corporate USD Index	Ближний Восток	Турция	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Austria Corporate USD Index	Западная Европа	Австрия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds United Kingdom Corporate USD Index	Западная Европа	Великобритания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Germany Corporate USD Index	Западная Европа	Германия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Denmark Corporate USD Index	Западная Европа	Дания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Spain Corporate USD Index	Западная Европа	Испания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Italy Corporate USD Index	Западная Европа	Италия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Netherlands Corporate USD Index	Западная Европа	Нидерланды	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Norway Corporate USD Index	Западная Европа	Норвегия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Finland Corporate USD Index	Западная Европа	Финляндия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds France Corporate USD Index	Западная Европа	Франция	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Switzerland Corporate USD Index	Западная Европа	Швейцария	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Sweden Corporate USD Index	Западная Европа	Швеция	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Brazil Corporate USD Index	Латинская Америка	Бразилия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Colombia Corporate USD Index	Латинская Америка	Колумбия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Mexico Corporate USD Index	Латинская Америка	Мексика	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Peru Corporate USD Index	Латинская Америка	Перу	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Chile Corporate USD Index	Латинская Америка	Чили	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Australia Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Австралия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Israel Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Израиль	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Canada Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Канада	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Republic of Korea Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Республика Корея	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Singapore Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Сингапур	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Japan Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Япония	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Kazakhstan Corporate USD Index	СНГ	Казахстан	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Russia Corporate USD Index	СНГ	Россия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds USA Corporate USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	США	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	2 000 000 000
Cbonds Russia Corporate CNY Index	СНГ	Россия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	CNY	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.09.2022	16	500 000 000

Cbonds Region Corporate

Cbonds Asia Corporate USD Index	Азия	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Africa Corporate USD Index	Африка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже ВЗ/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000

Cbonds Middle East Corporate USD Index	Ближний Восток	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Latin America Corporate USD Index	Латинская Америка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds CIS Corporate USD Index	СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds EM Corporate USD Index	Развивающиеся рынки и СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	750 000 000

Cbonds Country Corporate IG

Cbonds Hong Kong Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Гонконг	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds India Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Индия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Indonesia Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Индонезия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds China Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Китай	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Malaysia Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Малайзия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Thailand Corporate IG USD Index	Азия (искл. Японию)	Таиланд	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Qatar Corporate IG USD Index	Ближний Восток	Катар	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds United Arab Emirates Corporate IG USD Index	Ближний Восток	ОАЭ	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Saudi Arabia Corporate IG USD Index	Ближний Восток	Саудовская Аравия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Austria Corporate IG USD Index	Западная Европа	Австрия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Belgium Corporate IG USD Index	Западная Европа	Бельгия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds United Kingdom Corporate IG USD Index	Западная Европа	Великобритания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Germany Corporate IG USD Index	Западная Европа	Германия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Denmark Corporate IG USD Index	Западная Европа	Дания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Ireland Corporate IG USD Index	Западная Европа	Ирландия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Spain Corporate IG USD Index	Западная Европа	Испания	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Netherlands Corporate IG USD Index	Западная Европа	Нидерланды	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Norway Corporate IG USD Index	Западная Европа	Норвегия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Finland Corporate IG USD Index	Западная Европа	Финляндия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds France Corporate IG USD Index	Западная Европа	Франция	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Switzerland Corporate IG USD Index	Западная Европа	Швейцария	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Sweden Corporate IG USD Index	Западная Европа	Швеция	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Brazil Corporate IG USD Index	Латинская Америка	Бразилия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000

Cbonds Colombia Corporate IG USD Index	Латинская Америка	Колумбия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Mexico Corporate IG USD Index	Латинская Америка	Мексика	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Peru Corporate IG USD Index	Латинская Америка	Перу	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Chile Corporate IG USD Index	Латинская Америка	Чили	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Australia Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Австралия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Canada Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Канада	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Republic of Korea Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Республика Корея	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Singapore Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Сингапур	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Japan Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Япония	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Russia Corporate IG USD Index	СНГ	Россия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds USA Corporate IG USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	США	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2016	16	2 000 000 000

Cbonds Region Corporate IG

Cbonds Asia Corporate IG USD Index	Азия	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
---	------	-----	---------------------------	-------	-------	-----	-----	---	---	------------	------------	----	-------------

Cbonds Africa Corporate IG USD Index	Африка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Middle East Corporate IG USD Index	Ближний Восток	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Latin America Corporate IG USD Index	Латинская Америка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds CIS Corporate IG USD Index	СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds EM Corporate IG USD Index	Развивающиеся рынки и СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	750 000 000

Cbonds Country Corporate HY

Cbonds South Africa Corporate HY USD Index	Африка	ЮАР	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Italy Corporate HY USD Index	Западная Европа	Италия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Netherlands Corporate HY USD Index	Западная Европа	Нидерланды	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Brazil Corporate HY USD Index	Латинская Америка	Бразилия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Canada Corporate HY USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	Канада	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds Russia Corporate HY USD Index	СНГ	Россия	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds USA Corporate HY USD Index	Развитые рынки (искл. Европу)	США	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2016	16	2 000 000 000

Cbonds Region Corporate HY													
Cbonds Asia Corporate HY USD Index	Азия	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Africa Corporate HY USD Index	Африка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Middle East Corporate HY USD Index	Ближний Восток	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds Latin America Corporate HY USD Index	Латинская Америка	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds CIS Corporate HY USD Index	СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds EM Corporate HY USD Index	Развивающиеся рынки и СНГ	все	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	750 000 000

Cbonds Green Bonds													
Cbonds World Sovereign Green Bonds USD Index	Весь мир	Весь мир	еврооблигации и облигации	фикс.	гос.	USD	360	-	-	ежемесячно	01.01.2016	16	500 000 000
Cbonds World Corporate Green Bonds USD Index	Весь мир	Весь мир	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds World Corporate IG Green Bonds USD Index	Весь мир	Весь мир	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже Ваа3/ВВВ- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств.	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000
Cbonds World Corporate HY Green Bonds USD Index	Весь мир	Весь мир	еврооблигации и облигации	фикс.	корп.	USD	360	-	не ниже В3/В- и не выше Ва1/ВВ+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	ежемесячно	01.01.2017	16	500 000 000

Приложение 2: история изменений в методике расчета индексов

Дата	Индекс / Семейство индексов	До внесения изменений	После внесения изменений
01.04.2015	Euro-Cbonds IG Russia	Рейтинг: не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: не ниже Ва1/ BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.04.2015	Euro-Cbonds IG Russia RUB	Рейтинг: не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: не ниже Ва1/ BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.04.2015	Euro-Cbonds IG Russia EUR	Рейтинг: не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: не ниже Ва1/ BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.04.2015	Euro-Cbonds IG 3Y Russia	Рейтинг: не ниже Ваа3/BBB- по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: не ниже Ва1/ BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.04.2015	Euro-Cbonds Corporate Ukraine	Рейтинг: не ниже В3/ В- от ведущих рейтинговых агентств	-
01.01.2018	Euro-Cbonds Russia BB+/Ba1	Euro-Cbonds IG Russia	Euro-Cbonds Russia BB+/Ba1 (изменение названия индекса)
01.01.2018	Euro-Cbonds NIG Sovereign EM	Рейтинг: не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: от В3/В- до Ва1 /BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.01.2018	Euro-Cbonds NIG Sovereign LatAm	Рейтинг: не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: от В3/В- до Ва1 /BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.01.2018	Euro-Cbonds NIG Sovereign Eastern Europe	Рейтинг: не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: от В3/В- до Ва1 /BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.01.2018	Euro-Cbonds NIG Sovereign Asia	Рейтинг: не выше Ва1/BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств	Рейтинг: от В3/В- до Ва1 /BB+ по крайней мере от двух ведущих рейтинговых агентств
01.04.2019	Euro-Cbonds Corporate EM (BRL)		Перестали производить расчет в связи с тем, что ни одна облигация не попала в индексный список, согласно критериям формирования индексного списка.
05.07.2019	Euro-Cbonds Corporate Kazakhstan		В связи с существенными колебаниями цены бумаги Nostrum Oil & Gas, 8% 25jul2022, USD, она была исключена из индексного списка с 02.06.2019. Индекс пересчитан с 31.05.2019 по 04.07.2019.
05.07.2019	Euro-Cbonds NIG Corporate CIS		В связи с существенными колебаниями цены бумаги Nostrum Oil & Gas, 8% 25jul2022, USD, она была исключена из индексного списка с 02.06.2019. Индекс пересчитан с 31.05.2019 по 04.07.2019.

09.07.2019	Euro-Cbonds NIG Corporate EM		В связи с существенными колебаниями цены бумаги Nostrum Oil & Gas, 8% 25jul2022, USD, она была исключена из индексного списка с 02.06.2019. Индекс пересчитан с 31.05.2019 по 08.07.2019.
01.01.2020	Euro-Cbonds Sovereign EM, Euro-Cbonds IG Sovereign EM, Euro-Cbonds NIG Sovereign EM, Euro-Cbonds Corporate EM, Euro-Cbonds Corporate EM (CNY), Euro-Cbonds IG Corporate EM, Euro-Cbonds NIG Corporate EM		Из индексных списков исключены эмиссии эмитентов стран: Сингапур, Республика Корея, Пуэрто-Рико, Каймановы острова, Израиль, Бермудские острова в связи с исключением данных стран из региона Emerging Markets в базе данных Cbonds.
01.01.2020	Euro-Cbonds Sovereign LatAm, Euro-Cbonds IG Sovereign LatAm, Euro-Cbonds NIG Sovereign LatAm, Euro-Cbonds Corporate LatAm, Euro-Cbonds IG Corporate LatAm, Euro-Cbonds NIG Corporate LatAm		Из индексных списков исключены эмиссии эмитентов стран: Пуэрто-Рико, Каймановы острова, Бермудские острова в связи с исключением данных стран из региона Emerging Markets в базе данных Cbonds.
01.01.2020	Euro-Cbonds Sovereign Asia, Euro-Cbonds IG Sovereign Asia, Euro-Cbonds NIG Sovereign Asia, Euro-Cbonds Corporate Asia, Euro-Cbonds IG Corporate Asia, Euro-Cbonds NIG Corporate Asia		Из индексных списков исключены эмиссии эмитентов стран: Сингапур, Республика Корея в связи с исключением данных стран из региона Emerging Markets в базе данных Cbonds.
01.01.2020	Euro-Cbonds Sovereign Eastern Europe, Euro-Cbonds Sovereign Eastern Europe (EUR), Euro-Cbonds IG Sovereign Eastern Europe, Euro-Cbonds IG Sovereign Eastern Europe (EUR), Euro-Cbonds Corporate Eastern Europe, Euro-Cbonds IG Corporate Eastern Europe, Euro-Cbonds IG Corporate Eastern Europe (EUR), Euro-Cbonds NIG Corporate Eastern Europe, Euro-Cbonds NIG Corporate Eastern Europe (EUR)		Из индексных списков исключены эмиссии эмитентов страны Турция в связи с исключением страны из субрегиона Восточная Европа в базе данных Cbonds.
01.01.2020	Euro-Cbonds Sovereign Middle East, Euro-Cbonds IG Sovereign Middle East, Euro-Cbonds NIG Sovereign Middle East, Euro-Cbonds Corporate Middle East, Euro-Cbonds IG Corporate Middle East, Euro-Cbonds NIG Corporate Middle East		Из индексных списков исключены эмиссии эмитентов страны Израиль в связи с исключением страны из региона Emerging Markets в базе данных Cbonds. В индексный список включены эмиссии эмитентов страны Турция в связи с включением страны в субрегион Ближний Восток в базе данных Cbonds.

28.08.2020	Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR), Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR) D, Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR) PI, Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR) T-spread, Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR) YTM, Euro-Cbonds Corporate Netherlands (EUR) YTM eff - 23005		В связи с некорректным расчетом показателя доходности ввиду снижения цены и близкой даты oferty бумаги Selecta Group, 5.875% 1feb2024, EUR и Intralot Global Securities, 5.25% 15sep2024, EUR были исключены из индексного списка с 28.08.2020. Индекс пересчитаны с 01.07.2020 по 27.08.2020.
30.12.2020	Euro-Cbonds NIG Sovereign Eastern Europe, Euro-Cbonds IG Sovereign Africa		Расчет остановлен по причине формирования пустого индексного списка после применения фильтрующих критериев.
01.01.2021	Семейство индексов Cbonds Country Sovereign		Запуск новой линейки индексов.
25.07.2021	Семейство индексов Euro-Cbonds		Прекращен публичный расчет по указанному семейству индексов, индексы заменены новыми линейками индексов Cbonds Country Corporate, Cbonds Country Corporate IG, Cbonds Country Corporate HY, Cbonds Region Sovereign, Cbonds Region Corporate, Cbonds Region Corporate IG, Cbonds Region Corporate HY. Старые индексы остаются доступны в рамках услуги Cbonds Database.
25.07.2021	Семейства индексов Cbonds Country Corporate, Cbonds Country Corporate IG, Cbonds Country Corporate HY, Cbonds Region Sovereign, Cbonds Region Corporate, Cbonds Region Corporate IG, Cbonds Region Corporate HY		Запуск новой линейки индексов.
25.12.2021	Семейство индексов Cbonds Green Bonds: Cbonds World Sovereign Green, Cbonds World Corporate Green, Cbonds World Corporate IG Green, Cbonds World Corporate HY Green		Запуск новой линейки индексов.
01.03.2022	Cbonds Russia Corporate USD Index, Cbonds Russia Corporate IG USD Index, Cbonds Russia Corporate HY USD Index, Cbonds CIS Corporate USD Index, Cbonds CIS Corporate IG USD Index, Cbonds CIS Corporate HY USD Index		Пересмотр критериев формирования индексных списков. Кредитные рейтинги Российской Федерации и российских эмитентов зафиксированы на 01.02.2022
01.06.2022	Cbonds USA Corporate USD Index, Cbonds USA Corporate IG USD Index, Cbonds USA Corporate HY USD Index, Cbonds EM Corporate USD Index, Cbonds EM Corporate IG USD Index, Cbonds EM Corporate HY USD Index		Запуск новой линейки индексов.
01.10.2022	Cbonds EM Sovereign USD Index, Cbonds Russia Corporate CNY Index		Запуск новой линейки индексов.