

Схема индексов ЦФА



Оглавление

Общие положения	3
Методика расчёта индекса объёма рынка ЦФА в обращении	3
Методика расчёта индекса кумулятивного объёма рынка ЦФА.....	3
Методика расчёта индекса объёма рынка ЦФА с фиксированной доходностью	4
Методика расчёта индекса объёма новых ЦФА	4
Методика расчёта индекса количества эмитентов ЦФА	4
Методика расчёта индекса количества эмитентов ЦФА, не выпускавших облигации	5

Общие положения

Статистика Cbonds по рынку цифровых финансовых активов (ЦФА) отражает динамику состояния инновационного сегмента рынка ценных бумаг России. Статистика публикуется на регулярной основе и содержит следующие индексы:

- объем рынка ЦФА в обращении;
- количество ЦФА в обращении;
- кумулятивный объем рынка ЦФА;
- количество ЦФА;
- объём рынка ЦФА с фиксированной доходностью;
- количество ЦФА с фиксированной доходностью;
- объем новых ЦФА;
- количество новых ЦФА;
- количество эмитентов ЦФА;
- количество эмитентов ЦФА, не выпускавших облигации.

Методика расчёта индекса объёма рынка ЦФА в обращении

1. Список ЦФА для расчета индексов (далее - Индексный список) формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.
2. В Индексный список включаются выпуски, которые обращаются на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении»).
3. Индекс объема рынка рассчитывается как суммарный объем эмиссий по первоначальному / непогашенному номиналу (индекс рассчитывается по первоначальному номиналу, если не указано иное). В случае неполного размещения выпуска учитывается только фактически размещенный объем.
4. Если валюта выпуска отличается от валюты расчета индекса, то объем эмиссии переводится в валюту расчета индекса по курсу ЦБ РФ на отчетную дату.
5. Индекс количества ЦФА в обращении рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Методика расчёта индекса кумулятивного объёма рынка ЦФА

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.
2. В Индексный список включаются выпуски, обращающиеся или обращавшиеся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»), размещённые с 28.06.2022 г.
3. Индекс объема рынка рассчитывается как суммарный объем эмиссий по первоначальному / непогашенному номиналу (индекс рассчитывается по первоначальному номиналу, если не указано иное). В случае неполного размещения выпуска учитывается только фактически размещенный объем.

4. Если валюта выпуска отличается от валюты расчета индекса, то объем эмиссии переводится в валюту расчета индекса по курсу ЦБ РФ на отчетную дату.

5. Индекс количества ЦФА рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Методика расчёта индекса объёма рынка ЦФА с фиксированной доходностью

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.

2. В Индексный список включаются выпуски, обращающиеся или обращавшиеся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»), размещённые с 28.06.2022 г.

3. Из Индексного списка исключаются выпуски, размещённые с 28.06.2022 г., обращающиеся или обращавшиеся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена») и имеющие базисный(е) актив(ы).

4. Индекс объема рынка рассчитывается как суммарный объем эмиссий по первоначальному / непогашенному номиналу (индекс рассчитывается по первоначальному номиналу, если не указано иное). В случае неполного размещения выпуска учитывается только фактически размещенный объем.

5. Если валюта выпуска отличается от валюты расчета индекса, то объем эмиссии переводится в валюту расчета индекса по курсу ЦБ РФ на отчетную дату.

6. Индекс количества ЦФА с фиксированной доходностью рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Методика расчёта индекса объёма новых ЦФА

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.

2. В Индексный список включаются выпуски, у которых дата окончания размещения приходится на отчетный месяц.

3. Индексы новых размещений рассчитываются как суммарный объем эмиссий по первоначальному / непогашенному номиналу (индекс рассчитывается по первоначальному номиналу, если не указано иное). В случае неполного размещения выпуска учитывается только фактически размещенный объем.

4. Если валюта выпуска отличается от валюты расчета индекса, то объем эмиссии переводится в валюту расчета индекса по курсу ЦБ РФ на отчетную дату.

5. Индекс количества новых ЦФА рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Методика расчёта индекса количества эмитентов ЦФА

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.

2. В Индексный список включаются эмитенты, которые имеют хотя бы один выпуск ЦФА, обращающийся или обращавшийся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»), размещённый с 28.06.2022 г.

Методика расчёта индекса количества эмитентов ЦФА, не выпускавших облигации

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.
2. В Индексный список включаются эмитенты, которые имеют хотя бы один выпуск ЦФА, обращающийся или обращавшийся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»), размещённый с 28.06.2022 г.
3. Из Индексного списка исключаются эмитенты, которые имеют хотя бы один выпуск облигаций, обращающийся или обращавшийся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»). Также из Индексного списка исключаются бенефициары SPV (компаний специального назначения), если SPV имеет хотя бы один выпуск облигаций, обращающийся или обращавшийся на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении», «дефолт по погашению», «досрочно погашена», «погашена», «приостановлена»).