



ООО «Сбондс.ру»

ИНН/КПП 7801182940/781001001 т/ф 336-97-21 <https://cbonds.ru/>

196006, г. Санкт-Петербург, вн.тер.г. Муниципальный округ Московская застава, пр-кт Лиговский, д. 266, стр. 1, помещ. 12.1-Н.216

Методика расчёта индексов замещающих облигаций России

Оглавление

Общие положения	3
Объём рынка замещающих облигаций	3
Объём новых выпусков замещающих облигаций	3
Объём нетто выпусков замещающих облигаций.....	4

Общие положения

Статистика Cbonds по рынку замещающих облигаций отражает динамику состояния данного сегмента рынка ценных бумаг России. Статистика публикуется на регулярной основе и содержит следующие индексы:

- Объем рынка замещающих облигаций;
- Объем новых выпусков замещающих облигаций;
- Объем нетто выпусков замещающих облигаций;
- Количество выпусков замещающих облигаций;
- Количество новых выпусков замещающих облигаций;
- Количество нетто выпусков замещающих облигаций.

Объём рынка замещающих облигаций

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний рабочий день.
2. В Индексный список включаются выпуски, у которых одновременно выполняются следующие условия:
 - обращаются на внутреннем рынке по состоянию на отчетную дату (имеют статус «в обращении»);
 - имеют признак «замещающие облигации»;
 - не являются иностранными облигациями.
3. Индекс объёма 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 выпусков замещающих облигаций рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Объём новых выпусков замещающих облигаций

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.
2. В Индексный список включаются выпуски, у которых одновременно выполняются следующие условия:
 - дата окончания размещения (доразмещения) приходится на отчетный месяц;

- имеют признак «замещающие облигации»;
 - не являются иностранными облигациями.
3. Индекс новых размещений 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 дату размещения (доразмещения).
 5. Индекс количества новых выпусков замещающих облигаций рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.

Объём нетто выпусков замещающих облигаций

1. Индексный список формируется ежемесячно на последний календарный день месяца.
2. В Индексный список включаются выпуски, у которых одновременно выполняются следующие условия:
 - дата окончания размещения (доразмещения) приходится на отчетный месяц;
 - имеют признак «замещающие облигации»;
 - не являются иностранными облигациями.
3. Из Индексного списка исключаются выпуски, дата погашения которых приходится на отчетный месяц.
4. Индекс нетто размещений 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 дату размещения (доразмещения).
6. Индекс количества нетто выпусков замещающих облигаций рассчитывается соответственно по полученному Индексному списку.