



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 индекса объема рынка ЦФА в обращении на основании данных ОИС

Формула расчета:

$$V_{\text{рынка}} = V_{\text{ОИС1}} + V_{\text{ОИС2}} + \dots + V_{\text{ОИСn}}$$

где:

$V_{\text{рынка}}$ — совокупный объем ЦФА в обращении по данным ОИС, предоставивших информацию, руб.;

$V_{\text{ОИС1}}, V_{\text{ОИС2}}, \dots, V_{\text{ОИСn}}$ — объем ЦФА в обращении по каждому отдельному ОИС, руб.

Порядок расчета индекса:

1. Источником данных являются сведения, предоставленные операторами информационных систем, в которых осуществляется выпуск ЦФА.
2. Индекс объема ЦФА в обращении по каждому ОИС рассчитывается как суммарный объем выпусков ЦФА в обращении по номиналу на отчетную дату.
3. Совокупный индекс объема ЦФА в обращении по данным ОИС рассчитывается как сумма значений индексов по всем ОИС, предоставившим информацию за отчетный месяц.
4. В расчет не включаются выпуски ЦФА, полностью погашенные, аннулированные или по иным основаниям не находящиеся в обращении на отчетную дату.
5. Если валюта выпуска отличается от валюты расчета индекса, то объем выпуска переводится в валюту расчета индекса по курсу Банка России на отчетную дату.
6. В настоящей методике указывается список ОИС, информация от которых учитывается при расчете индекса: Альфа-Банк, Атомайз, Сбербанк России, Токеон, ЦФА Хаб.

Cbonds выражает искреннюю благодарность ОИС, принявшим участие в составлении индексов!

Контактная информация:

Бударин Александр

Head of Russia and CIS Fixed Income Department

e-mail: a.budarin@cbonds.info
