|  |  |
| --- | --- |
|  | **УТВЕРЖДЕНА**  Правлением ПАО Московская Биржа  «23» января 2025 года, Протокол № 4  Председатель Правления  ПАО Московская Биржа  \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ В.О.Жидков |

**Методика расчета Индексов накопленной доходности RUSFAR**

ПАО МОСКОВСКАЯ БИРЖА, 2025

1. Настоящая Методика определяет порядок расчета Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – Биржа) индексов накопленной доходности RUSFAR (далее – Индексы) на основе информации о значениях индикаторов рынка репо с центральным контрагентом RUSFAR, рассчитываемых Биржей.
2. Настоящая Методика, а также все изменения и дополнения к ней, утверждаются Биржей и вступают в силу в дату, определяемую Биржей.
3. Наименования Индексов, индикаторов RUSFAR, используемых для расчета Индексов (далее – Индикаторы RUSFAR), валюта расчета Индексов приводятся в Приложении 1 к Методике.
4. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней разрабатываются с учетом рекомендаций Комитета по РЕПО и кредитованию ценными бумагами Биржи.
5. Деятельность по созданию и расчету Индексов, внесение изменений в настоящую Методику основано на совокупности административных принципов и правил, описанных в Политике Индекс-менеджмента Московской Биржи.
6. Текст утвержденной Методики раскрывается Биржей не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления ее в силу, если иное не определено решением уполномоченного органа Биржи.
7. Термины и определения, используемые в настоящей Методике, применяются в значениях, установленных внутренними документами ПАО Московская Биржа, а также законами Российской Федерации, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.
8. Расчет Индексов производится по следующей формуле:

где:

PIn – значение Индекса в день n, выраженное в валюте расчета Индекса;

PIn-1 – значение Индекса в день n-1, выраженное в валюте расчета Индекса;

RUSFARn-1 – значение Индикатора RUSFAR в день n-1, выраженное в сотых долях;

Dnorm – количество календарных дней со дня n-1 (исключая день n-1) по день n (включая день n), относящееся к невисокосному году;

Dleap – количество календарных дней со дня n-1 (исключая день n-1) по день n (включая день n), относящееся к високосному году.

1. Расчет значений индикаторов осуществляется с точностью до двух знаков после запятой.
2. Индексы рассчитываются каждый день, являющийся расчетным днем для Индикаторов RUSFAR. В случае отсутствия значений индикаторов RUSFAR или резервных значений индикаторов RUSFAR в день расчета, значения Индексов не определяются.
3. В случае возникновения технического сбоя при расчете Индексов либо индикаторов RUSFAR, используемых для расчета Индексов, приведшего к искажению данных, использовавшихся для расчета Индексов или индикаторов RUSFAR, допускается перерасчет рассчитанных ранее значений Индексов. Указанный перерасчет осуществляется в максимально короткие сроки с момента обнаружения технического сбоя. При перерасчете значений индикаторов соответствующее сообщение раскрывается на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
4. Информация о значениях Индексов за предыдущий расчетный день раскрывается каждый расчетный день Индикаторов RUSFAR не позднее 12:00 московского времени.
5. Архивная информация о значениях Индексов за весь период расчета раскрывается на официальном сайте Биржи в сети Интернет.
6. Информация, подлежащая в соответствии с настоящей Методикой раскрытию на официальном сайте Биржи в сети Интернет, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах ценными бумагами на Бирже.

Приложение 1 к Методике расчета Индексов Московской Биржи накопленной доходности RUSFAR

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Код индекса** | **Наименование на русском языке** | **Наименование на английском языке** | **Наименование индикатора RUSFAR, используемого для расчета** | **Валюта расчета** | **Начальное значение** | **Дата начала расчета** |
| RUSFARIND | Индекс накопленной доходности RUSFAR | MOEX RUSFAR accrued yield index | RUSFAR | RUB | 1000 | 09.01.2018 г. |

Словесное обозначение «MOEX» является товарным знаком ПАО Московская Биржа, зарегистрированным Федеральной службой по интеллектуальной собственности в Государственном реестре товарных знаков и знаков обслуживания Российской Федерации 29 августа 2014 года (свидетельство на товарный знак № 521450).

Словесное обозначение «RUSFAR» является товарным знаком ПАО Московская Биржа, зарегистрированным Федеральной службой по интеллектуальной собственности в Государственном реестре товарных знаков и знаков обслуживания Российской Федерации 11 апреля 2019 года (свидетельство на товарный знак № 0707709).