

УТВЕРЖДЕНА  
Правлением Акционерного общества  
«Санкт-Петербургская Валютная  
Биржа»  
(протокол от 01.06.2022 № 30)

**МЕТОДИКА РАСЧЕТА ФОНДОВЫХ ИНДЕКСОВ  
АКЦИОНЕРНОГО ОБЩЕСТВА  
«САНКТ - ПЕТЕРБУРГСКАЯ ВАЛЮТНАЯ БИРЖА»**

Санкт-Петербург  
2022

## 1. Термины и определения

(1) В настоящей «Методике расчета фондовых индексов акционерного общества «Санкт - Петербургская Валютная Биржа» (далее - Методика) применяются следующие термины и определения:

*База расчета индекса* - список акций, по которым рассчитывается фондовый индекс (далее - индексный список), и количество каждой ценных бумаг, входящих в индексный список. Индексный список, а также все изменения в списке утверждаются Правлением Биржи.

(2) Термины, специально не определенные в настоящей Методике, используются в значениях, установленных Правилами организованных торгов Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее - Биржа), а также законами и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

(3) Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней, утверждаются Правлением Биржи и вступают в действие в дату, определенную Правлением Биржи.

## 2. Общие положения

(1) Основной фондовый индекс акций (далее – Индекс, краткое латинское обозначение SPCEX IndexS) определяется на основе цен договоров с акциями в Фондовой секции Биржи и является интегральным индексом, характеризующим общее состояние рынка акций на Бирже.

(2) Индекс используется в индикативных и аналитических целях, а также в целях приостановления торгов.

(3) Индекс рассчитывается не реже одного раза в минуту в ходе основной торговой сессии. Для расчета берутся текущие цены ценных бумаг, входящих в индексный список.

## 3. Порядок расчета Индекса

(1) Индекс рассчитывается по следующей формуле:

$$I = D \times I_f \times \frac{\sum_{i=1}^N Q_i \times P_i}{\sum_{i=1}^M Q_i^f \times P_i^f}$$

где:

$Q_i$  - количество ценных бумаг  $i$ -го вида в обращении (определяется как объем эмиссии данной ценной бумаги);

$P_i$  - текущая цена ценной бумаги  $i$ -го вида;

$N$  - количество ценных бумаг в индексном списке на момент расчета Индекса;

$Q_j^f$  - количество ценных бумаг  $j$ -го вида в обращении на момент определения первого значения Индекса;

$P_j^f$  - средневзвешенная цена ценной бумаги  $j$ -го вида на момент определения первого значения Индекса;

$M$  - количество ценных бумаг в индексном списке на момент определения первого значения Индекса;

$D$  - поправочный коэффициент, корректирующий значение индекса при изменении базы расчета Индекса;

$I_f$  - значение Индекса на дату первого произведенного расчета (на начало расчета Индекса  $I_f = 100$ ).

(2) Поправочный коэффициент  $D$  рассчитывается по следующей формуле:

$$D = \frac{I_0}{I}$$

где:

$I$  - значение Индекса, рассчитанное с учетом изменения Базы расчета индекса с использованием текущего поправочного коэффициента;

$I_0$  - значение Индекса, рассчитанное без учета изменения Базы расчета индекса с использованием текущего поправочного коэффициента.

(3) Расчет Индекса осуществляется по ценным бумагам не менее 10 эмитентов, при условии включения указанных ценных бумаг в индексный список.

(4) Изменение Базы расчета Индекса производится в следующих случаях:

- включение новой ценной бумаги в Базу расчета индекса;
- изменение количества ценных бумаг, входящих в Базу расчета индекса на момент начала расчета.

(5) Источником информации, на основании которой рассчитывается Индекс, является информация о текущих ценах акций в Фондовой секции Биржи.

(6) Настоящая Методика не предполагает внесения изменений в показатели, используемые в расчете Индекса, на основании субъективной (экспертной) оценки.

#### **4. Порядок определения цены каждой ценной бумаги, включенной в индексный список**

(1) Определение цены каждой ценной бумаги осуществляется исходя из текущих цен договоров с указанными ценными бумагами, совершенными на торгах

*Методика расчета фондовых индексов Акционерного общества  
«Санкт-Петербургская Валютная Биржа»*

в Фондовой секции Биржи.

(2) Текущая цена ценной бумаги рассчитывается не реже одного раза в минуту в течение основной Торговой сессии в соответствии с Методикой расчета цен ценных бумаг Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

#### **5. Порядок определения количества ценных бумаг, учитываемых при расчете индекса по каждой ценной бумаге из индексного списка**

(1) Количество каждого выпуска ценных бумаг, по которым рассчитывается Индекс, определяется исходя из количества указанных ценных бумаг, находящихся в обращении.

#### **6. Порядок расчета доли стоимости ценных бумаг в индексном списке**

(1) Доля стоимости ценных бумаг из индексного списка в суммарной стоимости ценных бумаг, по которым рассчитывается Индекс, рассчитываются по следующей формуле:

$$S_i = 100 \times \frac{Q_i \times P_i}{\sum_{i=1}^N Q_i \times P_i}$$

где:

$Q_i$  - количество ценных бумаг  $i$ -го вида в обращении (определяется как объем эмиссии данной ценной бумаги);

$P_i$  - текущая цена ценной бумаги  $i$ -го вида;

$N$  - количество ценных бумаг в индексном списке;

$D$  - поправочный коэффициент, корректирующий значение Индекса при изменении базы расчета Индекса;

$S_i$  - доля стоимости ценных бумаг  $i$ -го выпуска в Индексе (в процентах).

#### **7. Критерии, которым должны соответствовать ценные бумаги для включения в индексный список**

(1) Критерием, которому должны соответствовать акции, для их включения в индексный список, является соответствие акций требованиям для их включения в котировальный список Первого уровня в части количества акций эмитента в свободном обращении и их общей рыночной стоимости.

## 8. Сроки расчета Индекса и его раскрытия

(1) Биржа раскрывает на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сайт Биржи) настоящую Методику (в том числе с внесенными в нее изменениями), а также информацию о значениях Индекса, количестве ценных бумаг, учитываемом при расчете Индекса по каждой ценной бумаге из индексного списка, и доле стоимости этих ценных бумаг, в суммарной стоимости ценных бумаг, по которым рассчитывается Индекс. Указанные документ и сведения подлежат раскрытию на сайте Биржи не позднее чем за три рабочих дня до введения их в действие. Методика и информация, предусмотренная настоящим пунктом, должна быть доступна любому заинтересованному лицу за последние 2 года, а если Индекс рассчитывается менее 2 лет – за все время, в течение которого он рассчитывается.

(2) Изменения в индексный список, в настоящую Методику, вносятся не чаще одного раза в квартал.

(3) Дата вступления в силу индексного списка устанавливается приказом Управляющего Биржи.

(4) Требования пункта (2) не применяются в случаях исключения ценных бумаг из списка ценных бумаг, допущенных к торгам в Фондовой секции Биржи, а также в случаях реорганизации или ликвидации эмитента ценных бумаг, размещения дополнительного выпуска ценных бумаг, аннулирования (погашения) ценных бумаг, в том числе в результате их конвертации, выкупа (приобретения) ценных бумаг их эмитентом, приостановки торгов ценными бумагами, а также в иных случаях, которые могут оказать существенное влияние на расчет Индекса. В этих случаях сообщение об изменениях в индексный список, в настоящую Методику раскрывается на сайте Биржи не позднее даты вступления их в силу.

(6) Начальное значение Индекса:

Наименование Индекса	Начальное значение Индекса	Дата первого произведенного расчета Индекса
SPCEX IndexS		