



АО «Сбондс.ру»

196006, Санкт-Петербург, пр-кт Лиговский, д. 266, стр. 1

Телефон: +7 (812) 336-97-21, e-mail: pro@cbonds.info

<http://www.cbonds.ru>

МЕТОДИКА РАСЧЕТА ИНДЕКСОВ ЦЕН ИНВЕСТИЦИОННЫХ СЛИТКОВ И МОНЕТ

Настоящая Методика определяет правила и порядок расчета индексов инвестиционных слитков и монет.

Общие положения

1. Индекс инвестиционных слитков и монет публикуется в разделе «Индексы».
2. В расчете индекса используются котировки участников рынка, указанных в таблице «Котировки участников рынка».
3. К участникам рынка относятся банки и финансовые организации, предоставляющие котировки по соответствующему инструменту.
4. Расчет индекса осуществляется на ежедневной основе.

Методика расчета

Индекс рассчитывается как среднее значение котировок участников рынка с учетом следующих правил:

1. С источников, указанных в таблице «Котировки участников рынка», на текущую дату собираются котировки bid и ask.
2. Если у источника отсутствует котировка bid, для него собирается только котировка ask.
3. Если у источника отсутствует котировка ask, либо отсутствуют и bid, и ask, котировки такого источника в расчет не принимаются.
4. Если значение ask меньше значения bid, котировки такого источника не принимаются к расчету.

5. При отсутствии данных на текущую дату используются данные за предыдущую дату.

Алгоритм расчета

1. Отбор котировок

В расчет включаются котировки источников, по которым на дату расчета доступны одновременно значения bid и ask. Источники, у которых доступно только значение ask, в расчет среднего значения индекса не включаются.

2. Расчет среднего значения по каждому источнику

Для каждого отобранного источника рассчитывается среднее значение по формуле:

Среднее значение источника = $(bid + ask) / 2$

3. Расчет итогового значения индекса

Итоговое значение индекса рассчитывается как среднее арифметическое значений, полученных по всем источникам, соответствующим условиям отбора:

Индекс = $\Sigma(\text{средних значений источников}) / N$

где:

- N — количество источников, включенных в расчет;
- $N \geq 1$.

4. Альтернативный порядок расчета при отсутствии достаточного числа источников

Если количество доступных источников, по которым есть одновременно bid и ask, меньше 1, значение индекса рассчитывается по формуле:

Индекс = Цена драгметалла по ЦБ РФ \times Чистый вес слитка/монеты

где:

- Цена драгметалла по ЦБ РФ — учетная цена металла, установленная Банком России;
- Чистый вес слитка/монеты — масса драгоценного металла в изделии.

Заключительные положения

Данная методика обеспечивает расчет индекса на основе рыночных котировок участников рынка. В случае недостаточности рыночных данных используется резервный порядок расчета на основе учетной цены драгоценного металла Банка России и чистого веса изделия.