

УТВЕРЖДЕНА
Приказом Генерального директора
ООО УК «Альфа-Капитал»
№ 78/26 от «02» июня 2026 г.

**Методика расчета индикатора «Альфа Капитал Всепогодный
Бенчмарк»**

Москва, 2026

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. ВВЕДЕНИЕ	3
1.1. Термины и определения	3
1.2. Общие положения	3
2. РАСЧЕТ ИНДИКАТОРА.....	3
2.1. Используемые данные	3
2.2. Порядок расчета.....	3
3. РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ	3

1. Введение

1.1. Термины и определения

- 1.1.1. В целях настоящей Методики расчета индикатора «Альфа Капитал Всепогодный Бенчмарк» (далее – Методика) применяются следующие термины и определения:
- Московская Биржа – ПАО Московская Биржа
 - Индекс 1 – Индекс МосБиржи государственных облигаций в рублях (код индекса RGBITR), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/RGBITR>
 - Индекс 2 – Индекс МосБиржи полной доходности «брутто» (код индекса MCFTR), сведения о порядке расчета раскрываются на сайте <https://www.moex.com/ru/index/totalreturn/MCFTR>
 - Золото – пара золото/российский рубль с расчетом на следующий после заключения сделки рабочий день (GLDRUB_TOM), торгуемая на Валютном рынке и рынке драгоценных металлов Московской биржи

1.2. Общие положения

- 1.2.1. Наименования и коды Индикаторов:

Код индикатора	Наименование на русском языке	Наименование на английском языке	Тип индикатора
IAKAB	Альфа Капитал Всепогодный Бенчмарк	Alfa Capital All-weather Benchmark Index	Полной доходности

- 1.2.2. Внесение изменений и дополнений в Методику осуществляется по инициативе Стратегического управления ООО УК «Альфа-Капитал».

2. Расчет индикатора

2.1. Используемые данные

Для расчета значения индикатора используются значения Индекса 1 и Индекса 2 и цена золота на закрытие торгов.

2.2. Порядок расчета

- 2.2.1. Значение индикатора на дату t , начиная с $t=1$ рассчитывается как:

$$IAKAB(t) = 0,4 * RGBITR_t + 0,4 * MCFTR_t + 0,2 * GLDRUB_TOM_t$$

- 2.2.2. Каждое последующее значение индикатора рассчитывается на каждую дату, в которую Московской Биржей проводился расчет Индексов 1, 2 и проводились торги всеми инструментами, используемыми в расчете индекса.
- 2.2.3. Если на календарную дату расчет значения индикатора невозможен, его значение устанавливается равным последнему рассчитанному значению.
- 2.2.4. Расчет индикатора начинается с даты расчета первой СЧА по Открытому паевому инвестиционному фонду рыночных финансовых инструментов «Слон, лягушка и брокколи»

3. Раскрытие информации

- 3.1.1. Раскрытие информации, предусмотренное Методикой, осуществляется в сети Интернет на странице www.alfacapital.ru.