

УТВЕРЖДЕНА

Решением генерального директора
Общества с ограниченной ответственностью
«Бета Финансовые Технологии»,
Приказ № 23 года 12 января 2022

Методика расчета

Beta US Equity Futures Tracking Index

Индекс Фьючерса на S&P500® Американских Акций

ОГЛАВЛЕНИЕ

<u>1</u>	<u>КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ ИНДЕКСА</u>	<u>3</u>
<u>2</u>	<u>ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ</u>	<u>4</u>
<u>3</u>	<u>ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДЕКСА.....</u>	<u>5</u>
<u>4</u>	<u>МЕТОДОЛОГИЯ ПЕРЕКАТА ФЬЮЧЕРСОВ МЕЖДУ СРОКАМИ ЭКСПЕРАЦИИ.....</u>	<u>5</u>
<u>5</u>	<u>ЦЕНА НА ФЬЮЧЕРСНЫЕ КОНТРАКТЫ НЕ ДОСТУПНА</u>	<u>7</u>
<u>6</u>	<u>РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНДЕКСА S&P 500®</u>	<u>10</u>
<u>7</u>	<u>РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ</u>	<u>11</u>

1 КРАТКОЕ ОПИСАНИЕ ИНДЕКСА

Краткое описание Индекса US Equity Futures tracking Index (USD) ("Beta US Equity Futures Tracking Index") представляет собой индекс Бета Финансовых Технологий БФТ, разработанные для следования за индексом S&P 500®. Базовым активом служат фьючерсные контракты E-mini на индекс S&P 500®, которые в настоящее время котируются для торговли на Чикагской товарной бирже ("CME"). Более подробная информация о фьючерсных контрактах и индексе S&P 500® представлена в разделах "Фьючерсные контракты E-mini на индекс S&P 500®" и "Индекс S&P 500®".

Beta US Equity Futures Tracking Index (Индекс) администрируется и рассчитывается счетным агентом БФТ. Beta US Equity Futures Tracking Index работает в соответствии с заранее определенной методологией и набором формул, и БФТ. Индекс является пассивным и расчет ведется согласно методологии. Расчетный агент индекса, не вносит никаких индивидуальных решений в отношении этого индекса. Таким образом, Индекс не является активно управляемым управляемым индексом. Как администратор индекса, БФТ не выступает в качестве инвестиционного консультанта и не выполняет функции управления в отношении Индекса, как следствие, не имеет фидуциарных обязательств перед любым лицом в отношении Индекса. Однако БФТ может предпринимать действия в ограниченном числе исключительных обстоятельств, включая, случаи, когда индекс S&P 500® пересчитывается или иным образом корректируется или изменяется, или, как администратор Индекса, когда цена оценки фьючерсного контракта не опубликована или иным образом недоступна, или, когда на индекс фьючерсной стратегии влияет событие, связанное с нарушением текущей биржевой и рыночной работы.

2 ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

В целях настоящей Методики расчета Индекса Цифровой Экономики (далее – «Методика»), компанией Бета Финансовые Технологии применяются следующие термины и определения:

Базовый актив	фьючерсы E-mini S&P 500®;
Фьючерсы E-mini S&P 500®	квартальные трехмесячные стандартизированные биржевые контракты на покупку или продажу. Одна единица фьючерсных контрактов на E-mini S&P 500® равна 50 долларам США, умноженным на значение индекса S&P 500® (вариант ценовой доходности).
Пережат фьючерса	закрытие открытой позиции по контракту с приближающейся датой экспирации и одновременное открытие позиции в пользу ближайшего контракта с более поздней датой экспирации. Фьючерсный контракт на индекс E-mini S&P 500®, ближайший к истечению срока действия в любой момент времени, известен как "первый ближайший" фьючерсный контракт, а фьючерсный контракт на E-mini S&P 500®, второй ближайший к истечению срока действия в любой момент времени, известен как "второй ближайший" фьючерсный контракт
Цена закрытия	цена последней сделки, завершенной в данный день в течение торговой сессии на официальной фондовой бирже;
Торговый день	каждый день, когда биржа CME открыта и проводятся организованные торги.
Начальное значение индекса	100 на дату 08 февраля 2012

Период переката

3 рабочих дня до экспирации фьючерсного контракта

Тикер	Название	RIC	ISIN	Валюта	Перекал
BFTUSE	Beta US Equity Futures Tracking Index	.BFTUSE	RU000A104JK6	USD	Квартал

3 ПОРЯДОК РАСЧЕТА ИНДЕКСА

3.1 Расчет Ежедневного Значение Индекса

В каждый торговый день, значение Индекса рассчитывается как произведение значения Индекса по состоянию на непосредственно предшествующий торговый день, умноженного на сумму дневного коэффициента доходности стоимости фьючерсных контрактов **E-mini S&P 500®** за n дней

$$ERI_t = r_t * ERI_{t-n}$$

ERI_t значение Индекса по состоянию на день t;

n количество фактических календарных дней между t и непосредственно предшествующим рабочим днем (t - n);

r_t ежедневная ценовая доходность стоимости фьючерсных контрактов **E-mini S&P500®** на день t;

t соответствующий торговый день;

4 МЕТОДОЛОГИЯ ПЕРЕКАТА ФЬЮЧЕРСОВ МЕЖДУ СРОКАМИ ЭКСПЕРАЦИИ

Каждый фьючерсный контракт имеет квартальный срок экспирации (март, июнь, сентябрь или декабрь). В каждый момент времени Индекс будет инвестирован в ближайшие фьючерсные

контракты E-mini **S&P 500®**. По мере истечения срока действия ближайших фьючерсных контрактов, они заменяются следующим после ближайшего фьючерса контрактами. Например, фьючерсный контракт инвестированный в мае, будет иметь экспирацию в июне. С течением времени контракт, истекающий в июне, заменяется фьючерсным контрактом с истечением в сентябре. В течение соответствующего периода роллированием. Этот процесс называется "перекатыванием".

Период перекатывания: Перекат будет осуществляться в течение трех рабочих дней, начиная с, и включая предпоследний торговый день, предшествующий последней торговой дате первого близлежащего фьючерсного контракта. Такой период время от времени именуется "период перекатывания". В каждый торговый день в течение периода перекатки, одна треть условной инвестиции в первого ближайшего фьючерсного контракта будет перенесена во второй ближайший фьючерсный контракт.

Расчет Индекса В Период Переката

$$\left\{ \begin{array}{l} r_t = \frac{P_{1,t}}{P_{1,t-n}} \\ \text{Вне 3 - х дневного периода перекладывания} \\ r_t = \left(1 - \frac{m-1}{3}\right) * \frac{P_{1,t}}{P_{1,t-n}} + \frac{m-1}{3} * \frac{P_{2,t}}{P_{2,t-n}} \\ \text{где на } m - \text{ый день периода перекладывания, } m = 1,2,3 \\ \text{Где:} \end{array} \right.$$

$P_{1,t}$ Цена закрытия ближайшего по экспирации фьючерсного контракта в день t; при условии, что, после того, весь объем позиции был перекатан в ближайшие фьючерсные контракты согласно данной методологии. Ближайшие фьючерсные контракты означают фьючерсные контракты, в которые были пролонгированы инвестиции

$P_{2,t}$ Цена закрытия фьючерсного контракт второго после ближайшего по экспирации в день t

n количество фактических календарных дней между t и непосредственно

предшествующим рабочим днем ($t - n$);

r_t ежедневная ценовая доходность стоимости фьючерсных контрактов на день t

5 ЦЕНА НА ФЬЮЧЕРСНЫЕ КОНТРАКТЫ НЕ ДОСТУПНА

5.1 Недоступность данных вне периода перекачивания:

Если в любой торговый день, который не попадает в период переката фьючерсов, цена на фьючерсные контракты не опубликуются или иным образом станут не доступны, то расчетный агент индекса не будет рассчитывать какое-либо значение для Индекса, но опубликует последнее доступное значение.

5.2 Недоступно в течение периода перекачки

В случае если для одного или обоих контрактов, близлежащего или второго близлежащего значения цен не доступны в течение времени перекачки фьючерсов, то такая перекачка будет осуществляться в соответствии со следующей альтернативная методология пересчета:

I. Случай 1: Если (а) цена фьючерсного контракта не опубликована или недоступна в первый торговый день перекачки фьючерсных контрактов для одного или обоих первых ближайших или вторых ближайших фьючерсных контрактов и (б) цена фьючерсного контракта доступна во второй торговый день периода перекачки для обоих первых ближайших фьючерсных контрактов, то:

- одна половина условной инвестиции в первый близлежащий фьючерсный контракт будет перенесена во вторые ближайшие фьючерсные контракты во второй торговый день периода перекачки; и
- если Цена фьючерсного контракта также доступна на третий торговый день периода перекачки как для первого близлежащего, так и для второго близлежащего фьючерсных контрактов, то вторая половина условной инвестиции в первый близлежащий фьючерсный контракт будут перенесены

во вторые близлежащие фьючерсные контракты в третий торговый день день периода перекатки; но

- если цена фьючерсного контракта не опубликована или иным образом недоступна на третий торговый день периода перекатки для одного или обоих первых ближайших и второго близлежащего фьючерсного контракта, то перекатка любой оставшейся части условной суммы инвестиций в первый близлежащий фьючерсный контракт будет осуществляться, как указано ниже, в соответствии со следующими условиями Случай IV

II. Случай 2: Если цена оценки фьючерсного контракта не опубликована или иным образом недоступна в первый и второй торговые дни периода перекатки для одного или обоих первых ближайших и вторых ближайших фьючерсных контрактов, или обоих из первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсных контрактов, то:

- если Цена оценки фьючерсного контракта доступна на третий торговый день периода перекатки для первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсных контрактов, то вся доля инвестиции в первый близлежащий фьючерсный контракт, переноситься во вторые ближайшие фьючерсные контракты на третий день биржи периода перекатки; но
- в противном случае, перекатка оставшейся части инвестиции переноситься в первые близлежащие фьючерсные контракты, как описано ниже в примере IV

III. Случай 3: Если цена оценки фьючерсного контракта доступна на первый торговый день периода перекатки для первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсных контрактов (в этот день одна треть условной инвестиции в первый близлежащий фьючерсный контракт переносится во вторые ближайшие фьючерсные контракты), но Цена оценки фьючерсного контракта Цена оценки фьючерсных контрактов не опубликована или недоступна по иным причинам во

второй торговый день периода переката для одного или обоих из первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсных контрактов. Фьючерсные контракты на акции, то оставшиеся две трети условной инвестиции в первый близлежащий и второй близлежащий фьючерсные контракты. Фьючерсные контракты будут переведены во вторые близлежащие фьючерсные контракты на третий торговый день периода перекачки, если только цена на фьючерсный контракт не опубликована или иным образом недоступна для одного или обоих из первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсного контракта.

- IV. Случай 4: В любой ситуации, когда цена оценки фьючерсного для одного или обоих из первого близлежащего и второго близлежащего фьючерсного контракта не опубликована или недоступна по иным причинам в третий торговый день периода пересчета (включая случаи, когда такая цена не опубликована или недоступна по иным причинам только в первый и третий рабочие дни периода пересчета, только во второй и третий рабочие дни периода перекачки или во все три рабочих дня периода перекачки), то любая оставшаяся сумма условной инвестиции в первые ближайšie фьючерсные контракты будет переведена во вторые ближайšie фьючерсные контракты на последнюю торговую дату первых ближайших фьючерсных контрактов, которая должна быть торговым днем, непосредственно следующим за третьим торговым днем периода перекачки фьючерсов. В такую последнюю торговую дату перекачка будет осуществляться с использованием специальной котировки открытия для первых ближайших фьючерсных контрактов и цены первой сделки для второго ближайшего Фьючерсного контракта, при условии, что если в такую последнюю торговую дату специальная котировка открытия первого ближайшего Фьючерсного контракта не опубликован, то первые ближайšie Фьючерсные контракты будут рассчитаны согласно последней доступной котировке
- V. Цена для таких первых ближайших фьючерсных контрактов на акции США на последний контрольный день (как определено ниже) а вторые ближайšie фьючерсные контракты на акции США будут куплены по цене оценки фьючерсных

контрактов на акции США. Цена оценки контракта для таких вторых близлежащих фьючерсных контрактов на акции США в последний контрольный день день.

6 РАСЧЕТ СТОИМОСТИ ИНДЕКСА S&P 500®

Индекс, более подробно рассмотренный ниже, основан на относительной стоимости совокупной средней рыночной стоимости акций 500 компаний по состоянию на конкретном времени по сравнению с совокупной средней рыночной стоимостью обыкновенных акций 500 аналогичных компаний в течение базового периода 1941-1943 годов. Standard & Poor's выбирает компании для включения в индекс с целью достижения распределения по широким отраслевым группам которое приблизительно соответствует распределению этих групп по количеству обыкновенных акций на Нью-Йоркской фондовой бирже. фондовой биржи, которую Standard & Poor's использует в качестве предполагаемой модели состава всего рынка. рынка. Соответствующие критерии, используемые Standard & Poor's, включают жизнеспособность конкретной компании, степень, в которой эта компания представляет отраслевую группу, к которой она отнесена, степень, в которой насколько рыночная цена обыкновенных акций этой компании обычно реагирует на изменения в делах соответствующей отрасли, а также рыночную стоимость и торговую активность обыкновенных акций этой компании. компании. Индекс включает в себя следующие десять основных групп компаний: потребительские товары, потребительские основные товары, энергетика, финансовые компании, здравоохранение, промышленные компании, информационные технологии, материалы, телекоммуникационные услуги и коммунальные услуги. Standard & Poor's может время от времени, по своему собственному усмотрению, добавлять компании в индекс или исключать их из него для достижения вышеуказанных целей. БФТ не несет ответственности за расчет индекса **S&P 500®**.

Индекс ценовой доходности и не отражает выплату дивидендов по акциям, входящим в индекс. В результате доходность продукта, привязанного к индексу, не будет такой же, как доходность, которую получили бы, если бы приобрести эти акции и держать их в течение

одинакового периода времени. Standard & Poor's в настоящее время рассчитывает индекс.

7 РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ

- 7.1 Раскрытие информации, предусмотренное Методикой, осуществляется на странице компании Бета Финансовые Технологии в сети Интернет по адресу: beta-ft.ru (далее – «**официальный сайт**»).
- 7.2 Текст Методики раскрывается на официальном сайте через неделю после вступления в силу, если иное не установлено решением компании Бета Финансовые Технологии.
- 7.3 Информация о значениях Индекса раскрывается не позднее, чем к 11:00 по московскому времени после Торгового дня.
- 7.4 Информационные сообщения об очередном пересмотре Базы расчета Индекса раскрываются на официальном сайте через неделю после вступления в силу решения компании Бета Финансовые Технологии об утверждении новой Базы расчета Индекса.
- 7.5 Информационные сообщения о внеочередном пересмотре Базы расчета раскрываются на официальном сайте через день после вступления в силу решения компании Бета Финансовые Технологии об утверждении новой Базы расчета.
- 7.6 Информация, подлежащая в соответствии с настоящей Методикой раскрытию на официальном сайте, дополнительно может распространяться иными способами, в том числе через информационные агентства, распространяющие данные о торгах ценными бумагами на Бирже.