



«Народный Портфель» – методология расчета

Определение

Народный портфель – это совокупная стоимость ценных бумаг, приобретенных клиентами-физлицами-резидентами на организованных торгах на рынках Московской Биржи, за вычетом ценных бумаг, проданных теми же клиентами на организованных торгах.

Для расчета учитываются только операции вторичного рынка. Сделки РЕПО не рассматриваются.

Алгоритм расчета

Пусть есть MDM_ID – золотой идентификатор конечного клиента-физлица, который работает (заключает сделки) с инструментом SEC_ID. Предположим, что на начальный момент времени – день t – клиент не владеет ни одним инструментом SEC_ID.

Тогда в день $T \geq t$ объем владения в бумагах составляет:

$$Poss_{T,MDM_ID}^{SEC_ID} = MAX(\sum_t^T Buy_{MDM_ID}^{SEC_ID} - \sum_t^T Sell_{MDM_ID}^{SEC_ID}; 0),$$

Где

$\sum_t^T Buy_{MDM_ID}^{SEC_ID}$ – объем сделок на покупку в штуках бумаг в период времени $[t;T]$

$\sum_t^T Sell_{MDM_ID}^{SEC_ID}$ – объем сделок на продажу в штуках бумаг в период времени $[t;T]$

Объем владения в рублях составляет на день T :

$$Poss_{T,R,MDM_ID}^{SEC_ID} = Poss_{T,MDM_ID}^{SEC_ID} \cdot Price_close_T^{SEC_ID},$$

Где

$Price_close_T^{SEC_ID}$ – цена закрытия по бумаге SEC_ID в день T .

Если $Price_close_T^{SEC_ID}$ указано в иностранной валюте (например, в случае акций иностранных эмитентов), пересчет производится по курсу Банка России, установленному на день T .

Отсюда стоимость народного портфеля по бумаге SEC_ID в день T определяется как

$$\sum_{MDM_ID} Poss_{T,R,MDM_ID}^{SEC_ID},$$

Т.е. как сумма по всем золотым клиентам-физлицам, которые в период времени $[t;T]$ работали с SEC_ID.

Начальная точка

Начальной точкой расчета выступает дата 01.01.2015 = t .



**МОСКОВСКАЯ
БИРЖА**

Порядок расчета

Расчет Народного портфеля делается по всем долевым ценным бумагам (акциям, паям, ДР, акциям Иностранных эмитентов) утром за предыдущий день.

Для месячных/квартальных/годовых отчетов Народный портфель считается на последний рабочий день завершившегося периода.