Описание показателя

Удельный вес ценной бумаги является показателем, характеризующим долю отдельной ценной бумаги в суммарной капитализации ценных бумаг, составляющих базу расчета индекса. Расчет удельного веса ценных должен производиться ежедневно по окончании торгов.

Методика расчета

Удельный вес ценной бумаги рассчитывается по следующей формуле: $Weight_i^k = \left(\frac{Cap_i^k}{\sum_{i=1}^{M} \left(Cap_i^k \right)} \right)$

Где: $Cap_i^k = P_i^k \cdot Q_i^k \cdot FF_i^k$

Обозначения:

Weight^k_i – доля i-й ценной бумаги в суммарной капитализации ценных бумаг, составляющих базу расчета индекса;
Cap^k_i – рыночная капитализация i-ой ценной бумаги, в дату расчета индекса;
P^k_i – цена i-ой ценной бумаги, включенной в базу расчета индекса, используемая при расчете соответствующего индекса, на конец k-го торгового дня;
Q^k_i – объем эмиссии i-ой ценной бумаги (в штуках);
FF^k_i – доля капитализации ценной бумаги, свободно обращающаяся на вторичном рынке (используется только при расчете удельного веса акций, составляющих базу расчета Индекса).