

УТВЕРЖДЕН
Приказом Генерального директора
ООО «УК ПРОМСВЯЗЬ»
№ 129 от «23» июня 2016 года

Методика оценки стоимости объектов доверительного управления и
осуществления прав по ценным бумагам

1. Общие положения

Настоящая Методика оценки стоимости объектов доверительного управления и осуществления прав по ценным бумагам (далее по тексту - Методика) разработана в соответствии с Положением Банка России от 03.08.2015 г. № 482-П «О единых требованиях к правилам осуществления деятельности по управлению ценными бумагами, к порядку раскрытия управляющим информации, а также требованиях, направленных на исключение конфликта интересов управляющего» (далее - Положение), иными нормативными актами Российской Федерации, а также методическими рекомендациями НАУФОР.

2. Порядок определения стоимости объектов доверительного управления

Денежные средства – стоимостью является номинальная стоимость денежных средств, входящих в состав портфеля клиента в валюте счета, определенной в договоре доверительного управления. При определении стоимости денежных средств в валюте, отличной от валюты счета, Управляющий производит переоценку в соответствии с правилами внутренней конвертации. Внутренняя конвертация - это перерасчет стоимости объектов доверительного управления в валюту счета, осуществляемый Управляющим по курсу или кросс-курсу рубля Российской Федерации и/или иной валюты к валюте счета, установленному Центральным банком Российской Федерации (Банком России) на дату такой внутренней конвертации (далее – Внутренняя конвертация).

Ценные бумаги, допущенные к обращению на российских организованных торгах, - оценочная стоимость определяется как рыночная цена, рассчитываемая в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации, предъявляемыми к порядку определения рыночной цены ценной бумаги, обращающейся на организованных торгах (далее – Рыночная цена).

Если на момент осуществления оценки ценной бумаги, информация о ее Рыночной цене раскрывается несколькими организаторами торговли на рынке ценных бумаг, оценочной стоимостью такой ценной бумаги признается Рыночная цена, информация о которой раскрывается на организованных торгах Группы "Московская Биржа" (далее – Московская Биржа). Если информация о Рыночной цене ценной бумаги не раскрывается Московской Биржей, оценочной стоимостью такой ценной бумаги признается наименьшая Рыночная цена, информация о которой раскрывается иными организаторами торговли на рынке ценных бумаг.

Если на момент осуществления оценки ценной бумаги, допущенной к обращению у организатора торговли на рынке ценных бумаг, информация о ее Рыночной цене не раскрывается ни одним организатором торговли на рынке ценных бумаг, оценочная стоимость такой ценной бумаги определяется независимым оценщиком или признается равной стоимости приобретения соответствующей ценной бумаги, включающей все расходы.

Ценные бумаги, не допущенной к организованным торгам, - оценочная стоимость определяется независимым оценщиком или признается равной стоимости приобретения соответствующей ценной бумаги, включающей все необходимые расходы.

Ценные бумаги иностранного эмитента – оценочной стоимостью является последняя цена закрытия рынка (Bloomberg Last), опубликованная в информационной системе «Блумберг». В случае отсутствия на дату определения стоимости ценной бумаги иностранного эмитента информации о последней цене закрытия рынка, их стоимость определяется как цена бид на закрытие торгов, опубликованная в информационной системе «Блумберг». В случае отсутствия на дату определения стоимости ценной бумаги иностранного эмитента информации о последней цене закрытия рынка и хотя бы одной цены бид, ее стоимость определяется исходя из последней имеющейся к дате заключения сделки последней цены закрытия рынка в пределах предшествующих 90 дней. В случае отсутствия вышеуказанной информации о ценах в информационной системе «Блумберг» стоимость такой ценной бумаги признается равной стоимости приобретения соответствующей ценной бумаги, включающей все необходимые расходы.

Опционные контракты – оценочной стоимостью опционного контракта является котировка покупателя, выставленная одним из ведущих брокеров для соответствующих опционных контрактов по состоянию

на день, в который производится расчет, а если этот день не является торговым днем на организованных торговых площадках, то по состоянию на последний торговый день; в случае отсутствия котировки покупателя, выставленной одним из ведущих брокеров для соответствующих опционных контрактов, их стоимость принимается равной нулю; при необходимости пересчета сумм в валюте, отличной от валюты счета, в валюту счета такой пересчет осуществляется путем внутренней конвертации; в случае закрытия позиции реальная стоимость опционного контракта может существенно отличаться от котировки, выставленной брокером.

Фьючерсные контракты - оценочной стоимостью фьючерсного контракта является значение вариационной маржи, рассчитанной организаторами торгов по итогам торгового дня или по итогам экспирации фьючерсного контракта; при необходимости пересчета сумм в валюте, отличной от валюты счета, в валюту счета такой пересчет осуществляется путем Внутренней конвертации.

3. Осуществления Управляющим прав по ценным бумагам

3.1. Права, удостоверенные ценными бумагами, находящимися в доверительном управлении, осуществляются Управляющим по своему усмотрению в пределах, установленных законодательством Российской Федерации. При осуществлении права голоса по ценным бумагам, находящимся в доверительном управлении (если такие ценные бумаги предполагают право голоса), Управляющий не руководствуется указаниями клиента.

3.2 Управляющий при осуществлении управления активами вправе, в том числе самостоятельно без согласования с клиентом осуществлять все правомочия собственника в отношении активов (все юридические и фактические действия), самостоятельно и от своего имени осуществлять права, удостоверенные ценными бумагами, в том числе личные неимущественные права.

3.3 Права, приобретенные Управляющим в результате действий по доверительному управлению активами, включаются в состав портфеля клиента.

3.4 Обязанности, возникшие в результате действий Управляющего по доверительному управлению активами (в том числе, по оплате приобретаемых ценных бумаг, уплате сборов, взимаемых фондовыми биржами, депозитариями, хранилищами, регистраторами, брокерами, платежными системами, оплате услуг независимого оценщика и др.), исполняются за счет имущества, составляющего активы.

3.5 Клиент обязан передать Управляющему все документы и сведения, необходимые последнему для исполнения обязанностей и осуществления прав по доверительному управлению своим портфелем, в течение 5 (пяти) дней с даты получения соответствующего требования.

3.6 Если в соответствии с договором доверительного управления Управляющий не уполномочен осуществлять по ценным бумагам, являющимся объектом доверительного управления, право голоса на общем собрании владельцев ценных бумаг, то Управляющий совершает действия, необходимые для осуществления клиентом права голоса по таким ценным бумагам, а также права требовать от эмитента ценных бумаг (лица, обязанного по ценной бумаге) их выкупа (погашения).

3.7 В случае осуществления Управляющим в отчетном периоде прав голоса по ценным бумагам клиента Управляющий указывает в Отчете клиента, по каким ценным бумагам он голосовал на общем собрании владельцев ценных бумаг с указанием выбранного им варианта голосования по каждому вопросу повестки дня.