

«22» июня 2018 г.

Приложение №4
К Договору доверительного управления ценными бумагами
согласно Стандартных стратегий управления
на условиях открытия и ведения Индивидуального инвестиционного счета

МЕТОДИКА ОЦЕНКИ СТОИМОСТИ ОБЪЕКТОВ ДОВЕРИТЕЛЬНОГО УПРАВЛЕНИЯ

Настоящая Методика оценки стоимости объектов доверительного управления применяется Доверительным Управляющим при приеме их от Учредителя управления в рамках Договора, при указании их оценочной стоимости в отчете Доверительного управляющего, а также в процессе деятельности по доверительному управлению.

1. Для определения оценочной стоимости долговых ценных бумаг (облигаций) Доверительный управляющий использует показатель «рыночная цена (3)», раскрываемый ПАО Московская Биржа.

1.1. При отсутствии показателя «рыночная цена (3)», Доверительный управляющий для определения оценочной стоимости использует данные информационного агентства Bloomberg по ценам, которые определяются по методике Bloomberg Valuation и Bloomberg Generic.

1.2. При невозможности определения оценочной стоимости по данным информационного агентства Bloomberg, Доверительный управляющий использует справедливые цены, рассчитанные Ценовым Центром НРД.

1.3. При отсутствии информации для определения оценочной стоимости долговых ценных бумаг (облигаций) в указанных выше источниках, оценочная стоимость такой ценной бумаги приравнивается к цене приобретения/приема в доверительное управление такой ценной бумаги согласно Договора.

1.4. В оценочную стоимость долговых ценных бумаг (облигаций) включается накопленный по ним купонный доход.

2. Для определения оценочной стоимости долевых ценных бумаг (акций) Доверительный управляющий использует показатель «рыночная цена (3)», раскрываемый ПАО Московская Биржа.

2.1. При отсутствии показателя «рыночная цена (3)», раскрываемого ПАО Московская Биржа, Доверительный управляющий использует справедливые цены, рассчитанные Ценовым Центром НРД.

2.2. Для долевых ценных бумаг (акций) обращающихся на других торговых площадках (биржах), Доверительный управляющий использует данные о ценах закрытия, размещенные на официальных сайтах этих площадок (бирж), при этом выбирается цена закрытия той торговой площадки (биржи) где средние объемы торгов по данной ценной бумаге за последние 30 торговых дней максимальны.

2.3. Для долевых ценных бумаг (акций), не обращающихся на Московской Бирже, оценочная стоимость приравнивается к цене приобретения/приема в доверительное управление такой ценной бумаги согласно Договора.

3. Для определения оценочной стоимости производных финансовых инструментов, обращающихся на торгах ПАО Московская Биржа, Доверительный управляющий использует рыночную цену последнего закрытого торгового дня ПАО Московская Биржа.

3.1. Для производных финансовых инструментов, обращающихся на других торговых площадках (биржах), Доверительный управляющий использует данные о ценах закрытия, размещенные на официальных сайтах этих площадок (бирж).

3.2. Для определения оценочной стоимости производных финансовых инструментов, не обращающихся на торгах ПАО Московская Биржа, Доверительный управляющий использует индикативную цену соответствующего инструмента, объявленную ПАО «Сбербанк», с которым у Доверительного управляющего заключен договор о возможности совершать сделки с производными финансовыми инструментами.

4. Оценочная стоимость денежных средств и иных финансовых инструментов, выраженных в иностранной валюте, определяется исходя из официальных курсов иностранных валют, установленных Банком России на соответствующую дату.

5. Доверительный управляющий вправе вносить изменения в настоящую Методику оценки стоимости объектов доверительного управления.

6. Настоящая Методика, а также изменения и дополнения к ней, подлежат раскрытию на официальном сайте Доверительного управляющего в сети интернет не позднее 10 (Десяти) календарных дней до дня их вступления в силу с указанием даты их размещения на сайте и даты их вступления в силу по адресу www.nsbank.ru.