



«СОГЛАСОВАНО»  
Генеральный директор  
ЗАО «Первый Специализированный Депозитарий»

  
/ Панкратова Г.Н./  
«15» ~~ноября~~ 2011 г.  


«УТВЕРЖДАЮ»  
Генеральный директор  
ООО «УК ПРОМСВЯЗЬ»

  
/ Рыбаков А.В./  
«15» ~~ноября~~ 2011 г.  


## Правила

определения стоимости активов и величины обязательств, подлежащих  
исполнению за счет указанных активов  
паевого инвестиционного фонда на 2012 год

Открытого индексного паевого инвестиционного фонда «Индекс ММВБ»  
под управлением ООО «Управляющая компания ПРОМСВЯЗЬ»

*(Лицензия на осуществление деятельности по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами от 20 декабря 2002 года №21-000-1-00096, выданная Федеральной службой по финансовым рынкам России)*

Настоящие Правила определения стоимости активов и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет активов Открытого индексного паевого инвестиционного фонда «Индекс ММВБ» под управлением Общества с ограниченной ответственностью «Управляющая компания ПРОМСВЯЗЬ» (далее – Фонд) разработаны в соответствии с Федеральным законом от 29.11.2001г. № 156-ФЗ «Об инвестиционных фондах» и Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов, стоимости чистых активов паевых инвестиционных фондов, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, а также стоимости чистых активов акционерных инвестиционных фондов в расчете на одну акцию, утвержденным Приказом ФСФР РФ от 15 июня 2005г. № 05-21/пз-н.

## **1. Общие положения**

Настоящие Правила определения стоимости активов и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет активов Фонда (далее – Правила) определяют:

- периодичность проведения оценщиком Фонда оценки стоимости имущества, подлежащего указанной оценке;
- правила выбора российских организаторов торговли на рынке ценных бумаг, по результатам торгов у которых определяются признаваемые котировки ценных бумаг;
- правила выбора иностранных фондовых бирж, по результатам торгов на которых определяется цена закрытия рынка ценных бумаг иностранных эмитентов;
- ставку (ставки) дисконтирования оставшихся платежей по денежным требованиям, составляющим активы Фонда;
- сведения о формировании резерва для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением фондом, формируемого за счет имущества, составляющего фонд, а также особенности формирования резерва на выплату вознаграждений;

Все термины, упоминаемые в настоящих Правилах, трактуются в соответствии с законодательством о ценных бумагах Российской Федерации.

Настоящие Правила определения стоимости активов и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет активов Фонда, применяются в течение 2012 года.

Внесение изменений в Правила в течение календарного года допускается в исключительных случаях, в том числе в случае внесения изменений в нормативные правовые акты, регулирующие Правила, изменения ставки рефинансирования Центрального банка Российской Федерации, приостановления действия или аннулирования лицензии организатора торговли на рынке ценных бумаг, по результатам торгов у которого определяется признаваемая котировка ценных бумаг.

## **2. Периодичность проведения оценщиком Фонда оценки стоимости имущества, подлежащего указанной оценке**

Оценка недвижимого имущества, прав на недвижимое имущество, и иного предусмотренного нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг имущества, составляющего Фонд, осуществляется оценщиком, указанным в Правилах доверительного управления Фондом.

Оценочная стоимость указанного в настоящем пункте имущества, в том числе при его отчуждении, признается равной итоговой величине стоимости этого имущества, содержащейся в отчете о его оценке, если с даты составления указанного отчета прошло не более 6 месяцев.

## **3. Правила выбора российских организаторов торговли на рынке ценных бумаг, по результатам торгов у которых определяются признаваемые котировки ценных бумаг**

3.1. Общество определяет признаваемые котировки ценных бумаг по результатам торгов у

следующих российских организаторов торговли на рынке ценных бумаг:

- ЗАО «Фондовая биржа ММВБ»;
- ОАО «Фондовая биржа РТС»;
- НП ФБ «Санкт-Петербург»;
- ЗАО «Санкт-Петербургская валютная биржа».

Степень округления признаваемой котировки определяется данными, предоставленными организаторами торговли на рынке ценных бумаг.

3.2. Общество устанавливает следующий порядок выбора признаваемых котировок ценных бумаг и инвестиционных паев фонда:

Котировки ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» имеет приоритет по сравнению с котировками ОАО «Фондовая биржа РТС», если на ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» невозможно получить признаваемую котировку, Общество использует котировку ОАО «Фондовая биржа РТС».

Если на ОАО «Фондовая биржа РТС» невозможно получить признаваемую котировку, Общество использует котировку НП ФБ «Санкт-Петербург».

Если на НП ФБ «Санкт-Петербург» невозможно получить признаваемую котировку, Общество использует котировку ЗАО «Санкт-Петербургская валютная биржа».

Если у перечисленных выше организаторов торговли отсутствует признаваемая котировка, то Общество использует последнюю признаваемую котировку российских организаторов торговли в вышеперечисленном порядке.

#### **4. Правила выбора иностранных фондовых бирж, по результатам торгов на которых определяется цена закрытия рынка ценных бумаг иностранных эмитентов**

Выбор иностранных фондовых бирж, по результатам торгов на которых определяется цена закрытия рынка ценных бумаг иностранных эмитентов, осуществляется по наименованию той фондовой биржи, которая указана в согласии на сделку покупки данной иностранной ценной бумаги при ее первом приобретении в фонд. В случае исключения ценной бумаги с указанной биржи, для котировок выбирается биржа с большим объемом сделок, совершенных с этой ценной бумагой на дату предшествующей ее исключению, и закрепляется за ней.

Котировки иностранных ценных бумаг, валюта которых не входит в перечень официальных валютных курсов по отношению к рублю, устанавливаемых Банком России каждый рабочий день, конвертируются в доллары США согласно курсу валют, опубликованному информационным агентством «Блумберг» (Bloomberg), на день оценки с дальнейшим пересчетом в рубли по курсу Банка России.

#### **5. Ставка дисконтирования оставшихся платежей по денежным требованиям, составляющим активы Фонда**

Ставка дисконтирования оставшихся платежей по денежным требованиям, составляющим активы Фонда, устанавливается равной двум третям ставки рефинансирования Центрального банка Российской Федерации. Итоговое значение округляется до двух знаков после запятой по правилам математического округления.

#### **6. Сведения о формировании резерва для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением фондом, формируемого за счет имущества, составляющего фонд, а также особенности формирования резерва на выплату вознаграждений**

6.1. Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением Фондом за счет имущества, составляющего Фонд, не формируется.

6.2. Стоимость чистых активов паевого инвестиционного фонда, в том числе среднегодовая стоимость чистых активов, а также расчетная стоимость инвестиционного пая паевого инвестиционного фонда определяются в рублях с точностью до 2 знаков после запятой по состоянию на 20 часов московского времени.