

СОГЛАСОВАНО

Начальник отдела спецдепозитарных услуг
Депозитария Банка ВТБ (ПАО)

УТВЕРЖДЕНО

Генеральный директор
ООО «БАЛТИНВЕСТ УК»

_____ Е.К. Борисова

_____ А.И. Демидов

«27» ноября 2015 г.

«25» ноября 2015 г.

ПРАВИЛА ОПРЕДЕЛЕНИЯ СТОИМОСТИ АКТИВОВ
ОТКРЫТОГО ПАЕВОГО ИНВЕСТИЦИОННОГО ФОНДА СМЕШАННЫХ ИНВЕСТИЦИЙ
«БАЛТИНВЕСТ – ФОНД СМЕШАННЫХ ИНВЕСТИЦИЙ»
ПОД УПРАВЛЕНИЕМ ОБЩЕСТВА С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ «БАЛТИНВЕСТ УК»
И ВЕЛИЧИНЫ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ, ПОДЛЕЖАЩИХ ИСПОЛНЕНИЮ
ЗА СЧЕТ УКАЗАННЫХ АКТИВОВ
на 2016 год

1.1. Настоящие Правила определения стоимости активов Открытого паевого инвестиционного фонда смешанных инвестиций «БАЛТИНВЕСТ – Фонд смешанных инвестиций» под управлением Общества с ограниченной ответственностью «БАЛТИНВЕСТ УК» (далее - фонд) и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов на 2016 год (далее – Правила) разработаны в соответствии с требованиями Положения «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», утвержденного Приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 15 июня 2005 года № 05-21/пз-н (далее – Положение о порядке и сроках определения стоимости чистых активов).

1.2. Настоящие Правила являются документом управляющей компании фонда (Общество с ограниченной ответственностью «БАЛТИНВЕСТ УК»), утверждаются Генеральным директором на очередной календарный год, согласовываются со специализированным депозитарием фонда (Банк ВТБ (публичное акционерное общество)) не позднее, чем за месяц до начала календарного года и действуют **по 31 декабря 2016 года**.

1.3. Внесение изменений в Правила в течение календарного года допускается в исключительных случаях по приказу Генерального директора управляющей компании, в том числе в случае внесения изменений в нормативные акты, регулирующие правила определения стоимости активов паевых инвестиционных фондов и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов, изменения ставки рефинансирования Банка России, приостановления действия или аннулирования лицензии биржи, по результатам организованных торгов у которой определяется признаваемая котировка ценных бумаг.

1.4. Настоящие Правила представляются в Банк России в течение 5 (пяти) рабочих дней с даты их утверждения и согласования со специализированным депозитарием фонда.

1.5. Информация, содержащаяся в Правилах, подлежит раскрытию в соответствии с нормативными актами в сфере финансовых рынков.

1.6. Стоимость активов фонда определяется как сумма денежных средств на счетах и во вкладах и оценочной стоимости иного имущества, составляющего указанные активы, которая определяется в соответствии с Положением о порядке и сроках определения стоимости чистых активов.

1.7. Стоимость чистых активов фонда определяется как разница между стоимостью активов фонда и величиной обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов, на момент определения стоимости чистых активов фонда.

1.8. Оценка стоимости имущества фонда, стоимость которого должна оцениваться оценщиком, не производится, так как оценщик не предусмотрен Правилами доверительного управления фондом.

1.9. Оценочная стоимость ценных бумаг, допущенных к организованным торгам на российских биржах, за исключением облигаций внешних облигационных займов Российской

Федерации, признается равной их признаваемой котировке, определенной следующими российскими биржами в порядке убывания приоритета:

- Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ»;
- Закрытое акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

1.10. Оценочная стоимость ценных бумаг иностранных эмитентов, прошедших процедуру листинга на иностранной фондовой бирже (за исключением еврооблигаций), признается равной цене закрытия рынка указанных ценных бумаг по итогам торгового дня на иностранной фондовой бирже, на которой совершена покупка данной ценной бумаги.

В случае отсутствия информации о цене закрытия на дату определения стоимости чистых активов, оценочная стоимость таких ценных бумаг признается равной последней цене закрытия, используемой для определения стоимости чистых активов.

В случае приобретения одинаковых ценных бумаг на нескольких иностранных фондовых биржах, в целях определения оценочной стоимости ценных бумаг берется цена закрытия той биржи, на которой была совершена первая покупка.

В случае исключения ценной бумаги из списка ценных бумаг, допущенных к торгам на указанной бирже, для определения котировок выбирается биржа из списка бирж, приведенного в Правилах доверительного управления фондом, с наибольшим в денежном выражении объемом сделок, совершенных с этой ценной бумагой, на дату, предшествующую дате ее исключения, и закрепляется за ней.

Оценочная стоимость ценных бумаг иностранных эмитентов, прошедших процедуру листинга на ЗАО «Фондовая биржа ММВБ», признается равной их признаваемой котировке.

Если цена закрытия рынка ценных бумаг иностранных эмитентов выражена в валюте, не включенной в перечень иностранных валют, официальные курсы которых по отношению к рублю устанавливаются Банком России, то при расчете оценочной стоимости таких ценных бумаг используются котировки данных валют к доллару США, представленные в информационной системе Bloomberg на день оценки.

1.11. Дисконтирование оставшихся платежей по денежным требованиям не производится, так как инвестиционной декларацией фонда не предусмотрено приобретение денежных требований по обязательствам из кредитных договоров либо договоров займа.

1.12. Формирование резерва для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением фондом, не допускается.

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

1.14. При определении стоимости чистых активов фонда учитываются изменения в активах фонда и обязательствах, подлежащих исполнению за счет указанных активов, произошедшие в период между предшествующим и текущим моментами определения стоимости чистых активов.

1.15. Настоящие Правила подлежат приведению в соответствие с Указанием Банка России от 25 августа 2015 года № 3758-У «Об определении стоимости чистых активов инвестиционных фондов, в том числе о порядке расчета среднегодовой стоимости чистых активов паевого

инвестиционного фонда и чистых активов акционерного инвестиционного фонда, расчетной стоимости инвестиционных паев паевых инвестиционных фондов, стоимости имущества, переданного в оплату инвестиционных паев» **не позднее 24 декабря 2015 года.**