



Согласовано

Утверждено

Генеральный директор
ЗАО «ПРСД»

Приказом № РС-14-14 от «25» ноября 2014 г.
Генерального директора
ООО «УК «Русский Стандарт»

_____ (Панкратова Г. Н.)

_____ (Касьянова Е.А.)

«__» ноября 2014 г.

«25» ноября 2014 г.

Правила определения стоимости активов Открытого паевого инвестиционного фонда денежного рынка «Юлий Цезарь» и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов на 2015 год

1. Настоящие правила определения стоимости активов Открытого паевого инвестиционного фонда денежного рынка «Юлий Цезарь» (далее – Фонд) и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов на 2015 год (далее – Правила) разработаны ООО «УК «Русский Стандарт» (далее – Управляющая компания) во исполнение 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 (далее – Положение), утвержденного приказом ФСФР РФ от 15 июня 2005 г. N 05-21/пз-н, на основании федерального закона от 29.11.2001 N 156-ФЗ "Об инвестиционных фондах", нормативных актов федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и иных действующих нормативных актов.
2. **Наименования российских организаторов торговли на рынке ценных бумаг, по результатам торгов у которых определяются признаваемые котировки ценных бумаг, или правила выбора таких организаторов торговли на рынке ценных бумаг.**

Признаваемая котировка находящихся в составе активов Фонда ценных бумаг, допущенных к торгам российским организатором торговли на рынке ценных бумаг, в том числе государственных ценных бумаг РФ, за исключением облигаций внешних

облигационных займов РФ, определяется по результатам торгов на ЗАО «Фондовая биржа ММВБ». При этом значение такой признаваемой котировки в рублях РФ принимается с тем же количеством знаков в дробной части, с которым она предоставляется организатором торговли.

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

Если у ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» на день оценки отсутствует признаваемая котировка, то для определения оценочной стоимости ценных бумаг, входящих в имущество Фонда, используется последняя известная признаваемая котировка ЗАО «Фондовая биржа ММВБ».

3. Наименования иностранных фондовых бирж, по результатам торгов на которых определяется цена закрытия рынка ценных бумаг иностранных эмитентов, или правила выбора таких фондовых бирж.

3.1. Оценочная стоимость ценной бумаги иностранного эмитента, прошедшей процедуру листинга на иностранной фондовой бирже (за исключением еврооблигаций), определяется в следующем порядке:

1) если ценная бумага была приобретена через профессионального участника рынка ценных бумаг, имеющего лицензию на осуществление брокерской или дилерской деятельности, то оценочная стоимость такой ценной бумаги признается равной цене закрытия рынка указанной ценной бумаги на той иностранной фондовой бирже, где была совершена ее первая покупка.

2) если ценная бумага была приобретена по договору купли-продажи, то оценочная стоимость одной ценной бумаги признается равной цене закрытия рынка указанных ценных бумаг на иностранной фондовой бирже, выбранной в соответствии со следующей очередностью:

- 1) Лондонская фондовая биржа (London Stock Exchange);
- 2) Нью-Йоркская фондовая биржа (New York Stock Exchange);
- 3) Насдак (Nasdaq);
- 4) Гонконгская фондовая биржа (Hong Kong Stock Exchange).
- 5) Американская фондовая биржа (American Stock Exchange);
- 6) Евронекст (Euronext Amsterdam, Euronext Brussels, Euronext Lisbon, Euronext Paris);
- 7) Ирландская фондовая биржа (Irish Stock Exchange);
- 8) Испанская фондовая биржа (BME Spanish Exchanges);

- 9) Итальянская фондовая биржа (Borsa Italiana);
- 10) Корейская биржа (Korea Exchange);
- 11) Люксембургская фондовая биржа (Luxembourg Stock Exchange);
- 12) Немецкая фондовая биржа (Deutsche Borse);
- 13) Токийская фондовая биржа (Tokyo Stock Exchange Group);
- 14) Фондовая биржа Торонто (Toronto Stock Exchange, TSX Group);
- 15) Фондовая биржа Швейцарии (Swiss Exchange);
- 16) Шанхайская фондовая биржа (Shanghai Stock Exchange).

В случае заключения более одной сделки покупки данной ценной бумаги на дату расчета стоимости активов, оценочная стоимость такой ценной бумаги признается равной цене закрытия рынка указанной ценной бумаги на той иностранной фондовой бирже, которая была определена при первой покупке данной ценной бумаги.

В случае исключения ценной бумаги иностранного эмитента из списка ценных бумаг, допущенных к торгам на иностранной фондовой бирже, информация с которой ранее использовалась для определения оценочной стоимости данной иностранной ценной бумаги, выбирается биржа из следующего списка иностранных фондовых бирж:

- 1) Лондонская фондовая биржа (London Stock Exchange);
- 2) Нью-Йоркская фондовая биржа (New York Stock Exchange);
- 3) Насдак (Nasdaq);
- 4) Гонконгская фондовая биржа (Hong Kong Stock Exchange).
- 5) Американская фондовая биржа (American Stock Exchange);
- 6) Евронекст (Euronext Amsterdam, Euronext Brussels, Euronext Lisbon, Euronext Paris);
- 7) Ирландская фондовая биржа (Irish Stock Exchange);
- 8) Испанская фондовая биржа (BME Spanish Exchanges);
- 9) Итальянская фондовая биржа (Borsa Italiana);
- 10) Корейская биржа (Korea Exchange);
- 11) Люксембургская фондовая биржа (Luxembourg Stock Exchange);
- 12) Немецкая фондовая биржа (Deutsche Borse);
- 13) Токийская фондовая биржа (Tokyo Stock Exchange Group);
- 14) Фондовая биржа Торонто (Toronto Stock Exchange, TSX Group);
- 15) Фондовая биржа Швейцарии (Swiss Exchange);

16) Шанхайская фондовая биржа (Shanghai Stock Exchange);

с наибольшим объемом торгов в штуках по количеству ценных бумаг, совершенной с этой ценной бумагой на дату, предшествующую её исключению, и закрепляется за ней.

В случае, если оценочная стоимость указанной ценной бумаги не может быть определена на дату расчета стоимости чистых активов, то оценочная стоимость такой ценной бумаги признается равной ее оценочной стоимости на последнюю дату расчета, предшествующую дате определения стоимости чистых активов.

Если валюта цены закрытия рынка ценной бумаги иностранного эмитента выражена в валюте, не включенной в перечень иностранных валют, официальные курсы которых по отношению к рублю устанавливаются Банком России, то при расчете оценочной стоимости такой ценной бумаги используется котировка валюты к доллару США, представленная в информационной системе Bloomberg на день оценки.

3.2. Величина накопленного купонного дохода ценной бумаги иностранного эмитента, прошедшей процедуру листинга на иностранной фондовой бирже, рассчитывается в следующем порядке:

- 1) определяется величина накопленного купонного дохода (далее – НКД) в расчете на одну ценную бумагу в валюте номинала такой ценной бумаги с полным количеством знаков в дробной части, публикуемой системой Bloomberg;
- 2) определяется величина НКД в расчете на одну ценную бумагу в рублях РФ, путем умножения НКД на одну ценную бумагу в валюте номинала на официальный курс валюты номинала по отношению к рублю, установленный Центральным Банком РФ на дату расчета. Полученное значение НКД в рублях РФ принимается к расчетам с округлением до двух знаков в дробной части.

4. Ставка (ставки) дисконтирования оставшихся платежей по денежным требованиям, составляющим активы паевого инвестиционного фонда, не устанавливается настоящими Правилами, так как данные активы не предусмотрены нормативными правовыми актами федерального органа исполнительной власти по рынку ценных бумаг и правилами доверительного управления Открытым паевым инвестиционным фондом денежного рынка «Юлий Цезарь».

5. Сведения о формировании резерва для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением Фондом, формируемым за счет имущества, составляющего такой фонд.

Резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением Фондом, не формируется.

6. Периодичность проведения оценщиком фонда оценки стоимости имущества, подлежащего указанной оценке.

В соответствии с правилами доверительного управления открытого паевого инвестиционного фонда, оценка имущества, составляющего Фонд, оценщиком не производится.

7. Внесение изменений в настоящие правила в течение календарного года допускаются в случаях предусмотренных действующим законодательством.

8. 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.

9. Настоящие Правила действуют по 31 декабря 2015 года включительно.