

ОБЩЕСТВО С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ
«УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ «ЭСЭ УПРАВЛЕНИЕ АКТИВАМИ»

**ИЗМЕНЕНИЯ И ДОПОЛНЕНИЯ № 6
В ПРАВИЛА ОПРЕДЕЛЕНИЯ СТОИМОСТИ ЧИСТЫХ АКТИВОВ
ЗАКРЫТОГО ПАЕВОГО ИНВЕСТИЦИОННОГО ФОНДА РЫНОЧНЫХ
ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ «КОЛЛЕКТИВНЫЕ ИНВЕСТИЦИИ»**

«СОГЛАСОВАНО»

«13» июня 2024 года

ООО «СДК «Гарант»

Директор Департамента
Депозитарного обслуживания
Котова И.В.

«УТВЕРЖДЕНО»

«13» июня 2024 года

Приказом № П202406131

ООО «УК «ЭСЭ Управление
активами»
Директор
Алешкевич А.Н.

Изложить п. 1.9 «Порядок конвертации величин стоимостей, выраженных в одной валюте, в рубли» в новой редакции:

Справедливая стоимость активов и обязательств, определенная в валюте, отличной от российского рубля, подлежит пересчету в рубли по биржевому курсу на дату расчета СЧА. Доступным рынком в целях определения биржевого курса является ПАО «Московская биржа».

В качестве биржевого курса применяются следующие цены:

- средневзвешенный курс сделок СПОТ (TOD) по соответствующей валютной паре на дату определения СЧА по состоянию на время окончания торгов (или на последний ближайший торговый день, если дата определения СЧА является не торговым днем, но не более 7 торговых дней).

В том случае, если биржевой курс валюты не установлен по причине отсутствия допуска валюты к торгам или отсутствия торгов отдельным инструментом, в том числе в случае приостановки/прекращения торгов, для целей оценки применяется курс Центрального банка Российской Федерации (далее – Банк России).

Если на дату определения СЧА для иностранной валюты не

ООО "УК" "ЭСЭ"
УПРАВЛЕНИЕ
АКТИВАМИ"
Алешкевич Антон Николаевич
13.06.2024 15:39:22

ООО "СДК "ГАРАНТ"
Котова Ирина Владимировна
13.06.2024 16:18:31

установлены биржевые курсы закрытия TOD ПАО «Московская биржа», а также не установлен курс Банка России, для пересчета в рубли используется кросс курс, определяемый следующим образом:

Кросс курс = $CUR/USD * USD/RUR$,

где:

USD/RUR – биржевой курс доллара США, на дату расчета СЧА;

CUR/USD - курс валюты, в которой выражена справедливая стоимость, к Доллару США, полученный по данным информационного агентства Сибондс об обменных курсах широкого перечня иностранных валют к доллару США.

В случае отсутствия курса валюты к доллару США, используется курс валюты к евро:

Кросс курс = $CUR/EUR * EUR/RUR$

В случае отсутствия данных в отношении кросс-курсов для расчета используется курс, определенный экспертным (мотивированным) суждением Управляющей компании.

Заменить п. 1.3.1. Правил «Правила подлежат применению с «08» мая 2024 года.» на «Правила подлежат применению с «21» июня 2024 года.»

Директор

Алешкевич А.Н.

ООО "УК "ЭСЭ"
УПРАВЛЕНИЕ
АКТИВАМИ"
Алешкевич Антон Николаевич
13.06.2024 15:39:22

ООО "СДК "ГАРАНТ"
Котова Ирина Владимировна
13.06.2024 16:18:31