

«Утверждено»
Приказом Генерального директора
ЗАО «ВТБ Капитал Управление активами»
от «25» ноября 2011 г.



«Согласовано»
ОАО Банк ВТБ
«18» ноября 2011 г.
Шушков В.В.



ПРАВИЛА

определения стоимости активов и величины обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов, открытого индексного паевого инвестиционного фонда «ВТБ – Индекс ММВБ» под управлением ЗАО «ВТБ Капитал Управление Активами»

на 2012 год

1. Настоящие Правила разработаны на основании «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 ФСФР от 15 июня 2005 г. № 05-21/пз-Н.

2. Настоящие Правила действуют до 31 декабря 2012 г.

3. Оценочная стоимость ценных бумаг, допущенных к торгам российским организатором торговли на рынке ценных бумаг, признается равной их признаваемой котировке, определенной организатором торговли – Закрытое акционерное общество «Фондовая биржа ММВБ».

Если на дату расчета стоимости активов организатором торговли ЗАО «Фондовая биржа ММВБ» не проводились торги, а также, если ценные бумаги, приобретенные на торгах, исключены из списка ценных бумаг, допущенных к торгам, оценочная стоимость указанных ценных бумаг признается равной их последней признаваемой котировке.

4. Ставка (ставки) дисконтирования оставшихся платежей по денежным требованиям, составляющим активы ПИФа, устанавливается в размере двух третей ставки рефинансирования Центрального Банка Российской Федерации.

5. При расчете стоимости чистых активов ПИФа, резерв для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением ПИФом, не формируется.

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