

«УТВЕРЖДЕНЫ»



Генеральный директор
Общества с ограниченной ответственностью
«ПЕРАМО»
О.Л. Мещерякова

«20» мая 2019 г.

«СОГЛАСОВАНО»



Генеральный директор
Закрытого акционерного общества
«Первый Специализированный Депозитарий»
Г.Н. Панкратова

«20» мая 2019 г.



ИЗМЕНЕНИЯ И ДОПОЛНЕНИЯ В ПРАВИЛА
определения стоимости чистых активов Интервального паевого инвестиционного фонда
рыночных финансовых инструментов «КОНСЕРВАТОРия»
под управлением Общества с ограниченной ответственностью «ПЕРАМО»
[паи фонда не предназначены для квалифицированных инвесторов]

В целях конкретизации Правил определения стоимости чистых активов Интервального паевого инвестиционного фонда рыночных финансовых инструментов «КОНСЕРВАТОРия» (далее – Правила СЧА) в части порядка определения справедливой стоимости облигаций российских эмитентов, для которых имеются наблюдаемые данные в отсутствии цен 1-го уровня (2-й уровень) внести следующие изменения и дополнения, вступающие в силу с 29 мая 2019 г.:

1. Изложить Приложение 2 Правил СЧА, в части «Модели оценки стоимости ценных бумаг, для которых определяется активный внебиржевой рынок или для которых имеются наблюдаемые данные в отсутствии цен 1-го уровня (2-й уровень)» для облигаций российских эмитентов:

СТАРАЯ РЕДАКЦИЯ	
Ценная бумага российского эмитента	Для облигаций российских эмитентов в порядке убывания приоритета: 1. Цена, рассчитанная Ценовым центром НРД по Методике определения справедливых цен НРД. 2. Модель оценки в соответствии с Приложением 19.

НОВАЯ РЕДАКЦИЯ	
Ценная бумага российского эмитента	Для облигаций российских эмитентов 1. Модель оценки в соответствии с Приложением 19.

2. Изложить Приложение 19 Правил СЧА, в части «Рублевые облигации российских эмитентов. Уровень 2.»

СТАРАЯ РЕДАКЦИЯ
Если для одного из 30 торговых дней, предшествующих дате расчета справедливой стоимости, имеется возможность определить справедливую стоимость с использованием котировок, применяемых для оценки по Уровню 1 (определяется <code>LEGAL_CLOSE_PRICE</code> при условии <code>VOLUME > 0</code> при наличии активного рынка), применяется метод корректировки последней исторической цены по соответствующим ценовым облигационным индексам (кроме случаев, когда основным рынком для облигации является внебиржевой рынок), ежедневно публикуемым Московской биржей (описание: www.moex.com/ru/index/RUABITR/about/): • индекс государственных облигаций <code>RGBI</code>; • индекс корпоративных облигаций <code>MICEXCBICP</code>; • индекс муниципальных облигаций <code>MICEXMBICP</code>.

НОВАЯ РЕДАКЦИЯ

Если для одного из 30 торговых дней, предшествующих дате расчета справедливой стоимости, имеется возможность определить справедливую стоимость с использованием котировок, применяемых для оценки по Уровню 1 (определяется `LEGAL_CLOSE_PRICE` при условии `VOLUME > 0` при наличии активного рынка), применяется метод корректировки последней исторической цены по соответствующим ценовым облигационным индексам (кроме случаев, когда основным рынком для облигации является внебиржевой рынок), ежедневно публикуемым Московской биржей (описание: www.moex.com/ru/index/RUABITR/about/):

- индекс государственных облигаций `RGBI` (**значение `CLOSE`**);
- индекс корпоративных облигаций `MICEXCBICP` (**значение `CLOSE`**);
- индекс муниципальных облигаций `MICEXMBICP` (**значение `CLOSE`**).