



открытие

БРОКЕР



DIR-25680-19194496

УТВЕРЖДЕН

Приказом от 19.05.2021 № 21.05/19.5-ОД

Вступает в силу с 27 мая 2021 года

**Директор департамента
инвестиционных продуктов и сервисов
АО «Открытие Брокер»**

_____/ А.М. Дубров /
19 мая 2021 года

МЕТОДИКИ
оценки активов в портфелях клиентов
АО «Открытие Брокер»

Москва 2021

МЕТОДИКА

модельной оценки структурных нот иностранных эмитентов в Портфеле ФР Global

Модельная оценка структурных нот иностранных эмитентов в Портфеле ФР Global используется, когда для целей расчета вознаграждения Брокера, подключения/отключения услуг и сервисов Брокера требуется определить стоимость Портфеля ФР Global. Если Брокер в указанных целях использует иные методы оценки структурных нот иностранных эмитентов в Портфеле ФР Global, это должно быть прямо предусмотрено Регламентом, Договором и/или раскрыто Брокером на Сайте, Личном кабинете, иным образом.

При расчете стоимости структурных нот иностранных эмитентов в Портфеле ФР Global по модельной оценке применяются следующие правила:

а. Для модельной оценки стоимости структурных нот Брокер использует цену приобретения структурной ноты (далее – ЦП) и расчетную цену структурной ноты MID (далее – MID) в соответствующих случаях, как это указано ниже в пунктах b, c, d, e. Цена приобретения структурной ноты определяется Брокером по методу FIFO на дату приобретения (First In - First Out). Цена MID определяется Брокером на основании доступных ему цен типа Bid и типа Ask, предоставляемых в информационной системе Блумберг (Bloomberg) поставщиками информации о ценах (эмитентом структурной ноты, контрагентом Брокера по приобретению структурной ноты, иными лицами). Брокер по своему усмотрению выбирает поставщика информации, по данным которого будет рассчитываться MID структурной ноты. MID на соответствующую дату определяется Брокером следующим образом: по среднему арифметическому между ценами типа Bid и типа Ask на выбранную дату; если цена типа Ask отсутствует (равна нулю) у поставщика информации, то MID равна цене типа Bid. Если отсутствует (равна нулю) цена типа Bid – Брокер использует значение MID, рассчитанное им ранее в ближайшую предшествующую дату. При отсутствии такого значения MID считается равным 0 (нулю).

b. В дату приобретения модельная оценка структурной ноты равна цене приобретения структурной ноты.

c. В течение 30 (Тридцати) календарных дней, следующих за датой приобретения, модельная оценка структурной ноты определяется следующим образом:

(i) если у Брокера на дату оценки отсутствует возможность определить значение MID, отличное от 0 (нуля), модельная оценка структурной ноты равна цене приобретения структурной ноты;

(ii) если Брокер на дату оценки определил значение MID, отличное от 0 (нуля), начиная с этой даты модельная оценка структурной ноты считается по следующей формуле:

$$MO = \frac{(30 - i) \times ЦП + i \times MID}{30}, \text{ где}$$

i – количество дней (до 30), прошедших от даты приобретения структурной ноты ;

ЦП – цена приобретения структурной ноты;

MID – расчетная цена MID.

d. Начиная с 30 календарного дня после даты приобретения структурной ноты, модельная оценка структурной ноты рассчитывается одним из следующих способов:

(i) если Брокер на дату оценки определил MID, модельная оценка структурной ноты рассчитывается как MID на соответствующую дату оценки;

(ii) если Брокер на дату оценки не определил MID, модельная оценка структурной ноты равна цене приобретения структурной ноты.

- е. Если структурная нота поступила на счет Клиента не в результате сделки её покупки, совершенной Брокером по поручению Клиента, то ее модельная оценка рассчитывается как MID на соответствующую дату оценки.
- ф. Модельная оценка структурных нот с одинаковым ISIN, приобретенных в разное время по разным ценам, рассчитывается как среднее арифметическое от модельных оценок каждой из этих структурных нот.
- г. Модельная оценка структурных нот рассчитывается в разрезе Инвестиционного счета.