

УТВЕРЖДЕНО

Генеральным директором

ООО «УК ФКБС»

Приказ от «09» декабря 2017 г. № 52



(подпись)

/ А.И. Кузнецов /
(расшифровка подписи)



**МЕТОДИКА
ОПРЕДЕЛЕНИЯ
ОБЩЕСТВОМ С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ
«УПРАВЛЯЮЩАЯ КОМПАНИЯ
ФОНДА КОНСОЛИДАЦИИ БАНКОВСКОГО СЕКТОРА»
ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОФИЛЯ
УЧРЕДИТЕЛЯ УПРАВЛЕНИЯ**

Москва, 2017

СОДЕРЖАНИЕ

1. ВВОДНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ	3
2. ТЕРМИНЫ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ.....	4
3. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОФИЛЯ.....	4
4. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ГОРИЗОНТА.....	5
5. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ЗНАЧЕНИЯ ДОПУСТИМОГО РИСКА.....	5
6. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ОЖИДАЕМОЙ ДОХОДНОСТИ.....	6
7. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ В ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПРОФИЛЬ	6
8. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	6
Приложение № 1	7

1. ВВОДНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Введение

1.1.1. Методика определения обществом с ограниченной ответственностью «Управляющая компания Фонда консолидации банковского сектора» инвестиционного профиля Учредителя управления (далее – Методика) устанавливает порядок определения Инвестиционного профиля Учредителя управления и перечень сведений, необходимых для его определения.

1.1.2. Методика разработана в соответствии с требованиями Положения Банка России от 03.08.2015 г. № 482-П «О единых требованиях к правилам осуществления деятельности по управлению ценными бумагами, к порядку раскрытия управляющим информации, а также требованиях, направленных на исключение конфликта интересов управляющего» и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации.

1.1.3. Общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания Фонда консолидации банковского сектора» (далее – ООО «УК ФКБС» или Доверительный управляющий) применяет данную Методику в целях осуществления мероприятий по финансовому оздоровлению кредитных организаций в соответствии с Федеральным законом от 10.07.2002 № 86-ФЗ «О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)» и Федеральным законом от 26.10.2002 № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)».

1.2. Область действия

Методика распространяется на инвестиционные операции, осуществляемые в рамках лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг по управлению ценными бумагами и договора доверительного управления.

1.3. Период действия и порядок внесения изменений

1.3.1. Методика вступает в силу по истечении 10 календарных дней с даты опубликования на официальном сайте Доверительного управляющего в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (<http://www.amfbc.ru/>).

1.3.2. Методика, все изменения к ней утверждаются и вводятся в действие приказом Генерального директора ООО «УК ФКБС».

1.3.3. Изменения в Методику вносятся в случаях изменения законодательства Российской Федерации, совершенствования системы по оценке стоимости объектов доверительного управления и т.п.

1.3.4. В случае изменения законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России и внутренних нормативных документов ООО «УК ФКБС» Методика, до приведения её в соответствие с такими изменениями, считается действующей в части, не противоречащей вышеуказанным документам.

2. ТЕРМИНЫ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

Доверительный управляющий - общество с ограниченной ответственностью «Управляющая компания Фонда консолидации банковского сектора»;

Допустимый риск – риск, который способен нести Учредитель управления на установленном Инвестиционном горизонте;

Инвестиционный портфель – совокупность инвестиционных объектов, разных категорий, видов и типов, различной срочности и уровня ликвидности, управляемых как единое целое;

Инвестиционный профиль – документ, содержащий совокупность значений трёх параметров: Инвестиционного горизонта, Допустимого риска и Ожидаемой доходности;

Инвестиционный горизонт – период времени, за который определяются Ожидаемая доходность и Допустимый риск;

Ожидаемая доходность – доходность от доверительного управления, на которую рассчитывает Учредитель управления в рассматриваемом Инвестиционном горизонте;

Учредитель управления – Банк России в целях осуществления мер по предупреждению банкротства кредитных организаций, которому Доверительный управляющий оказывает услуги в рамках деятельности профессионального участника рынка ценных бумаг по доверительному управлению ценными бумагами.

3. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОФИЛЯ

3.1. Определение Инвестиционного профиля осуществляется по каждому договору доверительного управления до наступления начальной даты Инвестиционного горизонта и устанавливается на весь срок соответствующего периода.

3.2. Инвестиционный профиль определяется на основе предоставляемой Учредителем управления «Анкеты (Инвестиционный профиль) Учредителя управления» (Приложении № 1 к Методике) (далее – Анкета).

Риск предоставления недостоверной информации или непредставление информации об изменении данных Инвестиционного профиля лежит на самом Учредителе управления.

3.3. На основе информации о Допустимом риске, объеме инвестиционного портфеля, сроке договора доверительного управления определяется Инвестиционный горизонт.

Если Инвестиционный горизонт меньше срока, на который заключается договор доверительного управления, то Ожидаемая доходность, Допустимый

риск и Инвестиционный профиль определяются за каждый Инвестиционный горизонт, входящий в указанный срок.

3.4. Сформированный Инвестиционный профиль предоставляется Учредителю управления для согласования.

Инвестиционный профиль отражается в документе, составленном в бумажной форме в двух экземплярах для каждой из сторон, и подписывается сторонами договора доверительного управления.

Доверительный управляющий осуществляет хранение документов, содержащих Инвестиционный профиль, и информации, на основании которой указанный Инвестиционный профиль определен, в течение срока действия договора доверительного управления, а также в течение трех лет со дня его прекращения.

3.5. Доверительный управляющий осуществляет доверительное управление ценными бумагами и денежными средствами Учредителя управления, принимая все зависящие от него разумные меры для достижения инвестиционных целей, исходя из установленного Инвестиционного профиля.

4. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ГОРИЗОНТА

4.1. Инвестиционный горизонт определяется Доверительным управляющим на основе инвестиционных целей, которые отражены в Анкете, так, чтобы он не превышал срок, на который заключается договор доверительного управления.

4.2. Если по истечении Инвестиционного горизонта договор доверительного управления с Учредителем управления продолжает действовать, Доверительный управляющий обязан определить Ожидаемую доходность, Допустимый риск и Инвестиционный профиль для нового Инвестиционного горизонта.

В этом случае до даты завершения установленного Инвестиционного горизонта Учредителю управления направляется информация с приложением Анкеты с целью изменения Инвестиционного профиля в соответствии с порядком внесения изменений раздела 7 настоящей Методики.

5. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ЗНАЧЕНИЯ ДОПУСТИМОГО РИСКА

5.1. Оценка способности нести Допустимый риск не проводится в отношении Учредителей управления, относящихся к квалифицированным инвесторам в силу закона или признанных квалифицированными инвесторами для целей операций с соответствующими финансовыми инструментами.

5.2. Допустимый риск для Банка России, являющегося квалифицированным инвестором в соответствии с Федеральным законом от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», не подлежит определению.

6. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ОЖИДАЕМОЙ ДОХОДНОСТИ

6.1. Ожидаемая доходность от доверительного управления определяется Учредителем управления с учетом целей осуществления мероприятий по финансовому оздоровлению кредитных организаций.

6.2. Ожидаемая доходность, указанная Учредителем управления при анкетировании согласно п. 3.1. Методики, не накладывает на Доверительного управляющего обязанности по ее достижению и не является гарантией для Учредителя управления.

6.3. Доверительный управляющий предпринимает все зависящие от него действия для достижения Ожидаемой доходности Учредителя управления при принятии риска в пределах Допустимого риска.

7. ПОРЯДОК ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ В ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПРОФИЛЬ

7.1. Для внесения изменений в Инвестиционный профиль Учредитель управления уведомляет Доверительного управляющего об изменении ранее предоставленной информации при анкетировании в порядке п.3.2 Методики.

7.2. После разработки и внесения изменений, Доверительный управляющий, не позднее пяти рабочих дней с даты получения информации от Учредителя управления, указанной в п.7.1 Методики, направляет новый Инвестиционный профиль Учредителю управления для согласования.

7.3. До даты согласования Учредителем управления Инвестиционного профиля в новой редакции, доверительное управление ценными бумагами и денежными средствами осуществляется в соответствии с Инвестиционным профилем, согласованным ранее.

7.4. Срок, в течение которого Доверительный управляющий приводит Инвестиционный профиль Учредителя управления в соответствие с новой редакцией Инвестиционного профиля, устанавливается в самом Инвестиционном профиле, направленном на согласование в соответствии с п. 7.2 Методики.

8. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

8.1. Данная Методика, а также изменения в нее должны быть раскрыты Доверительным управляющим на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети Интернет (<http://www.amfbc.ru/>) с указанием даты ее размещения на сайте.

Анкета (Инвестиционный профиль) Учредителя управления

Дата составления	
Полное наименование	
ИНН / КПП	
ОГРН	
Тип инвестора	
Дата начала действия договора доверительного управления	
Дата окончания действия договора доверительного управления	
Сумма передаваемых в доверительное управление средств, тыс. руб.	
<u>Инвестиционные цели Учредителя управления:</u> <i>(заполняется Учредителем управления)</i>	
Дата начала инвестиционного периода	
Дата окончания инвестиционного периода	
Желаемый уровень доходности, в процентном соотношении в годовом исчислении	
<u>Инвестиционный профиль Учредителя управления</u> <i>(определяется Компанией)</i>	
Инвестиционный период (даты начала и конца каждого интервала)	
Допустимый риск, в процентном соотношении	
Предполагаемая доходность инвестирования, в процентном соотношении в годовом исчислении (для каждого интервала – Инвестиционного горизонта)	

ДОВЕРИТЕЛЬНЫЙ УПРАВЛЯЮЩИЙ:

Подпись: _____

Ф.И.О. (представителя): _____

Дата: «__» _____ 20__ года

С указанным инвестиционным профилем согласен:

УЧРЕДИТЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ:

Подпись: _____

Ф.И.О. (представителя): _____

Дата: «__» _____ 20__ года