

**Порядок расчета доходности, среднемесячной доходности по каждой из предлагаемых стандартных стратегий за весь срок управления ценными бумагами и денежными средствами.**

1. Настоящий Порядок расчета доходности и среднемесячной доходности по каждой из предлагаемых стандартных стратегий за весь срок управления ценными бумагами и денежными средствами (далее – Порядок) разработан в целях исполнения требований «Положения 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» (утв. Банком России 03.08.2015 № 482-П).

2. Настоящий Порядок является единым для всех стандартных стратегий управления.

3. В целях настоящего порядка применяются следующие термины и определения:

Активы - денежные средства, ценные бумаги, требования и обязательства по всем договорам доверительного управления, входящим в состав стандартной стратегии управления.

Валюта стратегии – валюта, в которой производится оценка стоимости активов, ценных бумаг и денежных средств, передаваемых или выводимых из стратегии управления.

4. Оценка стоимости Активов (AV) производится в соответствии с утверждённой в ООО «УК МДМ» Методикой оценки стоимости объектов доверительного управления. Стоимость Активов рассчитывается по всем входящим в состав стратегии управления договорам доверительного управления, включая договоры, закрытые в течение периода расчета.

5. Доходность управления Активами в Валюте стратегии определяется по формуле:

$$R = \left( \prod_{i=1}^n \frac{\sum_{j=1}^m (AV_{ji} - CF_{ji} + S_{ji})}{\sum_{j=1}^m AV_{j(i-1)}} - 1 \right) \times 100, \text{ где:}$$

$R$  – абсолютная доходность управления активами за период  $n$  дней (в процентах);

$n$  – количество календарных дней в расчетном периоде;

$m$  - количество договоров;

$AV_{ji}$  - оценочная стоимость принадлежащих  $j$ -му учредителю управления объектов доверительного управления по состоянию на  $i$ -й календарный день расчетного периода;

$CF_{ji}$  – оценочная стоимость объектов доверительного управления, переданных или выведенных (со знаком минус)  $j$ -м учредителем управления в  $i$ -й календарный день расчетного периода;

$S_{ji}$  – размер выплаченного в  $i$ -й календарный день расчетного периода вознаграждения доверительному управляющему  $j$ -м учредителем управления.

6. Среднемесячная доходность ( $AR$ ) рассчитывается по формуле.

$$AR = \sqrt[T]{\prod_{t=1}^N \left( \frac{R_t}{100} + 1 \right)} \times 100, \text{ где:}$$

$R_t$  – абсолютная доходность за календарный месяц  $t$ , рассчитанная в соответствии с п.5;

$T$  – число месяцев, прошедших с начала передачи средств первым учредителем управления в стратегию управления. Данное число может быть дробным. Дробная часть рассчитывается как доля календарных дней в расчетном месяце  $t$  в случае, если расчет доходности по стратегии начинается не с первого дня месяца;

$N$  – целое число календарных месяцев в периоде расчета  $T$  (округление вверх),  $N = \lceil T \rceil$ .

7. Доходности, рассчитанные в соответствии с п.5 и п.6, округляются до 2-го знака после запятой.

8. Доходность, рассчитываемая в соответствии с п.6, определяется на всем сроке действия стратегии управления, начиная с даты передачи средств первым учредителем управления в стратегию управления.
9. Доходность, рассчитываемая в соответствии с п.6, определяется на каждый последний календарный день месяца.
10. Расчет Среднемесячной доходности производится не позднее окончания месяца, следующего за расчетным.
11. Показатели Среднемесячной доходности раскрываются на сайте ООО «УК МДМ» по стандартным стратегиям управления, предназначенным для неопределённого круга лиц, не позднее окончания месяца, следующего за расчетным.
12. Расчет показателей, предусмотренных п.5 и п.6, подлежит хранению в течение пяти лет с даты произведения расчёта.